



Halbjahresbericht zum 30. September 2018

UniAbsoluterErtrag

Verwaltungsgesellschaft:
Union Investment Luxembourg S.A.

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Vorwort	3
UniAbsoluterErtrag	5
Wertentwicklung des Fonds	5
Geografische Länderaufteilung	5
Wirtschaftliche Aufteilung	5
Zusammensetzung des Fondsvermögens	6
Zurechnung auf die Anteilklassen	6
Vermögensaufstellung	7
Devisenkurse	19
Zu- und Abgänge im Berichtszeitraum	19
Erläuterungen zum Bericht	30
Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft	32
Verwaltungsgesellschaft, Verwaltungsrat, Geschäftsführer, Gesellschafter, Portfoliomanagement, Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé), Verwahrstelle, Zahl- und Vertriebsstellen	35

Hinweis

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen, denen der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Vorwort

Union Investment – Ihrem Interesse verpflichtet

Mit einem verwalteten Vermögen von rund 337 Milliarden Euro zählt die Union Investment Gruppe zu den größten deutschen Fondsgesellschaften für private und institutionelle Anleger. Sie ist Experte für Fondsvermögensverwaltung in der genossenschaftlichen FinanzGruppe. Etwa 4,4 Millionen private und institutionelle Anleger vertrauen uns als Partner für fondsbasierte Vermögensanlagen.

Die Idee der Gründung 1956 ist heute aktueller denn je: Privatanleger sollten die Chance haben, an der wirtschaftlichen Entwicklung teilzuhaben - und das bereits mit kleinen monatlichen Sparbeiträgen. Die Interessen dieser Investoren sind bis heute zentrales Anliegen für uns, dem wir uns mit unseren rund 3.150 Mitarbeitern verpflichtet fühlen. Rund 1.240 Publikums- und Spezialfonds bieten privaten und institutionellen Anlegern Lösungen, die auf ihre individuellen Anforderungen zugeschnitten sind – von Aktien-, Renten- und Geldmarktfonds über Offene Immobilienfonds bis hin zu intelligenten Lösungen zur Vermögensbildung, zum Risikomanagement oder zur privaten und betrieblichen Altersvorsorge.

Die Basis der starken Anlegerorientierung von Union Investment bildet die partnerschaftliche Zusammenarbeit mit den Beratern der Volks- und Raiffeisenbanken. In rund 11.100 Bankstellen stehen sie den Anlegern für eine individuelle Beratung in allen Fragen der Vermögensanlage zur Seite.

Beste Beleg für die Qualität unseres Fondsmanagements: unsere Auszeichnungen für einzelne Fonds - und das gute Abschneiden in Branchenratings. So erhielten wir im Januar 2018 bei den Euro Fund Awards 2018 von den Redaktionen von Euro, Eurofondsexpress, Euro am Sonntag und Börse-Online zahlreiche Auszeichnungen für unsere Fonds. Zudem hat das Fachmagazin Capital in seinem Fonds-Kompass Union Investment im Februar 2018 erneut mit der Höchstnote von fünf Sternen bedacht und als Top-Fondsgesellschaft ausgezeichnet. Damit sind wir die einzige Fondsgesellschaft, die diese renommierte Auszeichnung seit ihrer erstmaligen Vergabe im Jahr 2003 ohne Unterbrechung erhalten hat.

Darüber hinaus wurde Union Investment im November 2017 bei den Scope Awards 2018 zum vierten Mal in Folge als bester Asset Manager in der Kategorie „Socially Responsible Investing“ prämiert. Außerdem erhielten wir den Scope Alternative Investment Award 2018 als „Bester Asset Manager Retail Real Estate Global“ und „Bester Asset Manager Retail Real Estate Germany“ im Bereich Offene Immobilienfonds.

Im Oktober 2017 wurde der Trading Desk von Union Investment als „Multi Asset Desk of the Year 2017“ von Strategic Insight/TheTRADE ausgezeichnet.

Steigende Zinsen belasten Staatsanleihen weltweit

Euro-Staatsanleihen tendierten zu Beginn des Berichtshalbjahres noch freundlich. Ab Mai belastete aber die schwierige Regierungsbildung in Italien. Je länger die Sondierungsgespräche andauerten, desto wahrscheinlicher wurde eine Regierungskoalition der eurokritischen Parteien. Die Notierungen italienischer Anleihen gaben stark nach und der Risikoaufschlag zehnjähriger Papiere gegenüber den als sicher geltenden Bundesanleihen schoss deutlich in die Höhe. Im Juni beruhigte sich die Lage dann wieder etwas, bis die Budgetverhandlungen im September erneut für Unruhe sorgten. Peripherieanleihen verloren daher im Berichtszeitraum deutlich, während die als sicher geltenden Papiere aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden immer wieder von der weiteren Eskalation im Handelsstreit zwischen China und den USA profitierten. In der Summe kam es, gemessen am iBoxx Euro Sovereign-Index, zu einem Verlust von 1,9 Prozent.

Der US-Rentenmarkt stand zunächst unter weiterem Abgabedruck und knüpfte an die negative Wertentwicklung aus dem Vorquartal an. Dabei kletterte die Rendite für zehnjährige Staatsanleihen über die Marke von drei Prozent. Als belastend erwiesen sich die guten Konjunkturdaten und die Angst vor höheren Inflationsraten. Vor allem die Energiepreise verteuerten sich im Jahresverlauf deutlich. Dazu trug auch die US-Administration selbst bei, indem sie das Atomabkommen mit dem Iran aufkündigte. Im weiteren Berichtsverlauf konnten die Verluste aber wieder nahezu vollständig aufgeholt werden. US-Präsident Trump verschärfte seine Rhetorik und kündigte immer wieder neue Handelsbeschränkungen gegenüber China und auch Europa an. Die verhängten Strafzölle werden zunehmend zu einer Belastung für den Welthandel. US-Staatsanleihen waren in diesem schwierigen Umfeld als sicherer Anlagehafen gefragt und handelten über die Sommermonate hinweg in einer engen Handelsspanne. Gegen Ende des Berichtszeitraums sorgte ein starker US-Arbeitsmarktbericht für Aufsehen. Schnell machten sich Inflationssorgen breit und ließen die Rendite zehnjähriger Schatzanweisungen bis auf knapp 3,1 Prozent steigen. Gemessen am JP Morgan Global Bond US-Index verloren US-Staatsanleihen daher in den vergangenen sechs Monaten 0,6 Prozent an Wert.

Der Markt für europäische Unternehmensanleihen preiste zunächst das Ende des Ankaufprogramms der Europäischen Zentralbank ein und musste höhere Risikoaufschläge verkraften. Gute Unternehmensergebnisse sorgten dann aber für eine Stabilisierung. Letztlich fiel der Verlust für das Segment, gemessen am BofA Merrill Lynch Euro Corporate-Index, mit 0,2 Prozent moderat aus.

Höhere US-Renditen, ein fester US-Dollar und die Sorge um den Welthandel führten bei Anleihen aus den Schwellenländern anfangs zu höheren Risikoaufschlägen und Kursverlusten. Im Spätsommer 2018 sorgte eine Zinserhöhung in der Türkei, ebenso wie die Gespräche mit dem Internationalen Währungsfonds in Argentinien, für eine Entspannung. Es folgte eine, gemessen am J.P. Morgan EMBI Global Diversified-Index, kräftige Erholungsbewegung. Per saldo ergab sich dennoch ein Minus von 1,3 Prozent.

Aktienmärkte größtenteils im Plus

Die globalen Aktienmärkte haben in den vergangenen sechs Monaten deutlich geschwankt, konnten aber insgesamt zulegen. Dabei haben sie sich regional jedoch sehr unterschiedlich entwickelt. Als marktstützend erwiesen sich die starken US-Unternehmensergebnisse, Aktienrückkäufe und eine lebhafte Fusions- und Übernahmeaktivität. Seit sich aber der US-Zollkonflikt insbesondere mit China deutlich verschärft hat, ist die Unsicherheit weltweit gestiegen. Belastend wirkte ebenfalls die geldpolitische Straffung der US-Notenbank Fed, mit der eine Aufwertung des US-Dollar und Krisen in Schwellenländern wie der Türkei, Argentinien und Brasilien einhergingen. Per saldo gewann der MSCI World-Index in lokaler Währung 7,9 Prozent.

In den USA kamen aufgrund starker Arbeitsmarktdaten wiederholt Sorgen auf, dass die Inflation deutlich steigen und die Notenbank Fed darauf mit einer strafferen Geldpolitik reagieren würde. Die Fed hielt entsprechend an ihrem Zinspfad fest. Seit dem Frühjahr belastete immer wieder der Handelsstreit zwischen den USA und China sowie weiteren Ländern. Andererseits sorgten außergewöhnlich gute Wirtschafts- und Unternehmenszahlen sowie die Stärke der US-Technologiewerte für kräftige Zuwächse. In den vergangenen sechs Monaten stieg der Dow Jones Industrial Average um 9,8 Prozent und der marktbreite S&P 500-Index gewann 10,3 Prozent.

Die Börsen in Europa wurden über weite Strecken von der italienischen Politik dominiert. Die schwierige Regierungsbildung im Frühjahr und die anhaltende Diskussion über die künftige Haushaltspolitik sorgten wiederholt für Unsicherheit. Unter dem Strich gewann der EURO STOXX 50-Index 1,1 Prozent, der STOXX Europe 600-Index legte um 3,3 Prozent zu.

Japanische Aktien konnten sich dem Handelskonflikt zeitweise nicht entziehen. Doch kam es zuletzt angesichts einer robusten Konjunktur und der deutlichen Abwertung des Yen zu kräftigen Kurszuwächsen. Der NIKKEI 225-Index stieg per saldo um 12,4 Prozent. Die Schwellenländer schlossen, gemessen am MSCI Emerging Markets-Index in lokaler Währung, mit -5,2 Prozent negativ ab. Die asiatische Region - insbesondere China - litt besonders unter der US-Zollpolitik.

Wichtiger Hinweis:

Die Datenquelle der genannten Finanzindizes ist, sofern nicht anders ausgewiesen, Datastream. Die Quelle für alle Angaben der Anteilwertentwicklung auf den nachfolgenden Seiten sind eigene Berechnungen von Union Investment nach der Methode des Bundesverbands Deutscher Investmentgesellschaften (BVI), sofern nicht anders ausgewiesen. Die Kennzahlen veranschaulichen die Wertentwicklung in der Vergangenheit. Zukünftige Ergebnisse können sowohl niedriger als auch höher ausfallen.

Detaillierte Angaben zur Verwaltungsgesellschaft und Verwahrstelle des Investmentvermögens (Fonds) finden Sie auf den letzten Seiten dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

Klasse A
WKN A14QFP
ISIN LU1206678580

Klasse -net- A
WKN A14QFO
ISIN LU1206679554

Klasse I
WKN A14TBZ
ISIN LU1235247720

Halbjahresbericht
01.04.2018 - 30.09.2018

Wertentwicklung in Prozent ¹⁾

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	10 Jahre
Klasse A	-2,05	-2,33	-3,82	-
Klasse -net- A	-2,19	-2,61	-4,65	-
Klasse I	-1,96	-2,15	-3,33	-

1) Auf Basis veröffentlichter Anteilwerte (BVI-Methode).

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

Luxemburg	52,81 %
Irland	13,06 %
Großbritannien	10,07 %
Frankreich	5,14 %
Schweiz	4,47 %
Deutschland	3,74 %
Vereinigte Staaten von Amerika	2,38 %
Europäische Gemeinschaft	2,16 %
Australien	1,57 %
Finnland	0,80 %
Griechenland	0,52 %
Cayman Inseln	0,28 %
Hongkong	0,06 %
Italien	0,06 %
Schweden	0,06 %
Dänemark	0,02 %
Belgien	0,01 %
Niederlande	0,01 %
Österreich	0,01 %
Spanien	0,01 %
Wertpapiervermögen	97,24 %
Optionen	0,17 %
Terminkontrakte	-0,81 %
Credit Default Swaps	-0,21 %
Sonstige Finanzinstrumente	-0,26 %
Bankguthaben	2,31 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	1,56 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

Investmentfondsanteile	84,92 %
Diversifizierte Finanzdienste	7,08 %
Multisektor	2,16 %
Staatsanleihen	1,83 %
Software & Dienste	0,22 %
Investitionsgüter	0,16 %
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,15 %
Transportwesen	0,11 %
Haushaltsartikel & Körperpflegeprodukte	0,08 %
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	0,08 %
Groß- und Einzelhandel	0,07 %
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0,06 %
Verbraucherdienste	0,06 %
Versicherungen	0,06 %
Lebensmittel- und Basisartikele Einzelhandel	0,05 %
Automobile & Komponenten	0,03 %
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	0,03 %
Lebensmittel, Getränke & Tabak	0,03 %
Telekommunikationsdienste	0,03 %
Versorgungsbetriebe	0,03 %
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,00 %
Wertpapiervermögen	97,24 %
Optionen	0,17 %
Terminkontrakte	-0,81 %
Credit Default Swaps	-0,21 %
Sonstige Finanzinstrumente	-0,26 %
Bankguthaben	2,31 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	1,56 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

UniAbsoluterErtrag

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 30. September 2018

	EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten: EUR 1.821.181.987,52)	1.907.915.708,92
Optionen	3.594.023,15
Bankguthaben	45.255.081,72
Sonstige Bankguthaben	36.364.166,49
Nicht realisierte Gewinne aus Zinsswapgeschäften	158.681,79
Zinsforderungen aus Wertpapieren	231.095,89
Forderungen aus Anteilverkäufen	370.311,00
Forderungen aus Wertpapiergeschäften	424.901,22
Sonstige Forderungen	1.564.797,40
	1.995.878.767,58

Verbindlichkeiten aus Anteilrücknahmen	-6.112.792,70
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten	-15.588.352,37
Nicht realisierte Verluste aus Devisentermingeschäften	-1.018.223,00
Nicht realisierte Verluste aus Swapgeschäften	-6.113.176,13
Nicht realisierte Verluste aus Credit Default Swaps	-4.063.325,13
Zinsverbindlichkeiten	-43.915,61
Zinsverbindlichkeiten aus Zinsswapgeschäften	-27.523,10
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften	-524.449,65
Sonstige Passiva	-1.401.014,55
	-34.892.772,24

Fondsvermögen **1.960.985.995,34**

Zurechnung auf die Anteilklassen

Klasse A

Anteiliges Fondsvermögen	613.858.238,58 EUR
Umlaufende Anteile	13.303.420,000
Anteilwert	46,14 EUR

Klasse -net- A

Anteiliges Fondsvermögen	1.263.913.375,81 EUR
Umlaufende Anteile	27.114.220,000
Anteilwert	46,61 EUR

Klasse I

Anteiliges Fondsvermögen	83.214.380,95 EUR
Umlaufende Anteile	879.010,000
Anteilwert	94,67 EUR

UniAbsoluterErtrag

Vermögensaufstellung zum 30. September 2018

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % ¹⁾
Aktien, Anrechte und Genussscheine								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Belgien								
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	EUR	24.000	29.900	1.000	75,2200	75.220,00	0,00
BE0974320526	Umicore S.A.	EUR	23.000	18.000	5.000	48,1700	240.850,00	0,01
							316.070,00	0,01
Cayman Inseln								
US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. ADR	USD	7.795	0	7.795	164,7600	1.105.824,18	0,06
US0567521085	Baidu Inc. ADR	USD	6.160	0	6.160	228,6800	1.212.905,80	0,06
US47215P1066	JD.com Inc. ADR	USD	43.102	0	43.102	26,0900	968.254,85	0,05
US6475811070	New Oriental Education & Technical Group ADR	USD	18.326	0	18.326	74,0100	1.167.820,96	0,06
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd.	HKD	30.249	0	30.249	323,2000	1.075.827,72	0,05
							5.530.633,51	0,28
Dänemark								
DK0060946788	Ambu A/S	DKK	26.000	20.000	6.000	154,3000	124.150,14	0,01
DK0060079531	DSV A/S	DKK	13.500	15.000	3.000	584,0000	234.943,88	0,01
							359.094,02	0,02
Deutschland								
DE000BAY0017	Bayer AG	EUR	12.000	7.000	5.000	76,5100	382.550,00	0,02
DE0005200000	Beiersdorf AG	EUR	26.000	19.000	7.000	97,1800	680.260,00	0,03
DE0008232125	Dte. Lufthansa AG	EUR	80.500	55.000	25.500	21,1600	539.580,00	0,03
DE0005552004	Dte. Post AG	EUR	99.000	87.000	12.000	30,7100	368.520,00	0,02
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA	EUR	4.000	0	4.000	23,8000	95.200,00	0,00
DE0006602006	Gea Group AG	EUR	27.500	25.000	2.500	30,6800	76.700,00	0,00
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA -VZ-	EUR	11.000	10.000	7.000	101,0500	707.350,00	0,04
DE000A1PHFF7	Hugo Boss AG	EUR	31.500	28.500	3.000	66,3200	198.960,00	0,01
DE0006231004	Infineon Technologies AG	EUR	69.000	80.000	2.000	19,5700	39.140,00	0,00
DE000A2LQ2L3	innogy SE	EUR	16.000	0	16.000	36,5500	584.800,00	0,03
DE0006599905	Merck KGaA	EUR	21.242	19.242	5.000	89,0000	445.000,00	0,02
DE0007164600	SAP SE	EUR	8.500	7.500	1.000	106,0000	106.000,00	0,01
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	EUR	11.000	6.000	5.000	37,8750	189.375,00	0,01
DE0007500001	thyssenkrupp AG	EUR	48.000	29.000	19.000	21,7400	413.060,00	0,02
							4.826.495,00	0,24
Finnland								
FI0009013403	Kone Corporation (New)	EUR	12.500	7.500	5.000	46,0200	230.100,00	0,01
FI0009003727	Wartsila Corporation	EUR	88.000	65.000	23.000	16,7900	386.170,00	0,02
							616.270,00	0,03
Frankreich								
FR0000120172	Carrefour S.A.	EUR	92.000	66.000	26.000	16,5000	429.000,00	0,02
FR0000130650	Dassault Systemes S.A.	EUR	6.832	7.932	3.400	128,7500	437.750,00	0,02
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	EUR	2.700	1.400	1.300	570,6000	741.780,00	0,04
FR0000121485	Kering S.A.	EUR	6.334	3.384	3.500	461,7000	1.615.950,00	0,08
FR0000121014	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	7.100	8.819	1.100	304,6000	335.060,00	0,02
FR0000131906	Renault S.A.	EUR	9.000	0	9.000	74,5000	670.500,00	0,03
FR0000125486	Vinci S.A.	EUR	15.800	9.800	6.000	82,0200	492.120,00	0,03
							4.722.160,00	0,24
Großbritannien								
GB00B07KD360	Cobham Plc.	GBP	50.000	0	50.000	1,1675	65.560,42	0,00
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc.	GBP	7.000	4.000	3.000	70,1600	236.388,14	0,01
GB0008847096	Tesco Plc.	GBP	665.000	480.000	185.000	2,3980	498.236,75	0,03
							800.185,31	0,04

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
Hongkong								
HK0000069689	AIA Group Ltd	HKD	163.869	0	163.869	69,9000	1.260.475,28	0,06
							1.260.475,28	0,06
Irland								
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings Plc.	EUR	165.474	158.474	22.000	13,1200	288.640,00	0,01
							288.640,00	0,01
Italien								
IT0003856405	Leonardo S.p.A.	EUR	65.000	45.000	20.000	10,3800	207.600,00	0,01
IT0004712375	Salvatore Ferragamo S.p.A.	EUR	50.000	35.000	15.000	20,6300	309.450,00	0,02
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	EUR	2.050.000	1.250.000	800.000	0,5230	418.400,00	0,02
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. -VZ-	EUR	1.550.000	950.000	600.000	0,4634	278.040,00	0,01
							1.213.490,00	0,06
Niederlande								
NL0000009538	Koninklijke Philips NV	EUR	16.000	11.000	5.000	39,2350	196.175,00	0,01
							196.175,00	0,01
Österreich								
AT0000APOST4	Österreichische Post AG	EUR	7.000	0	7.000	36,0200	252.140,00	0,01
							252.140,00	0,01
Schweden								
SE0011337708	AAK AB	SEK	26.000	0	26.000	154,0600	387.823,75	0,02
SE0011166610	Atlas Copco AB	SEK	83.000	67.000	16.000	256,2000	396.890,10	0,02
SE0000667891	Sandvik AB	SEK	50.000	18.000	32.000	157,7500	488.754,20	0,02
							1.273.468,05	0,06
Schweiz								
CH0012221716	ABB Ltd.	CHF	57.000	5.000	52.000	23,1900	1.063.011,28	0,05
CH0012142631	Clariant AG	CHF	98.025	110.025	8.000	25,5400	180.112,84	0,01
CH0102659627	GAM Holding AG	CHF	45.000	0	45.000	6,9700	276.489,77	0,01
CH0025238863	Kühne + Nagel International AG	CHF	4.000	0	4.000	155,5000	548.307,48	0,03
CH0038863350	Nestle S.A.	CHF	28.500	25.500	3.000	81,8200	216.378,70	0,01
CH0012032048	Roche Holding AG Genussscheine	CHF	4.000	0	4.000	237,7500	838.328,63	0,04
CH0418792922	Sika AG	CHF	9.500	6.300	3.200	142,9000	403.102,96	0,02
CH0012453913	Temenos AG	CHF	6.769	6.669	1.800	159,2000	252.609,31	0,01
							3.778.340,97	0,18
Spanien								
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	EUR	5.000	2.000	3.000	80,0200	240.060,00	0,01
							240.060,00	0,01
Börsengehandelte Wertpapiere							25.673.697,14	1,26
Aktien, Anrechte und Genussscheine							25.673.697,14	1,26
Anleihen								
Börsengehandelte Wertpapiere								
EUR								
GR0114030555	3,500 % Griechenland v.17(2023)		0	0	10.000.000	101,1860	10.118.600,00	0,52
							10.118.600,00	0,52
Börsengehandelte Wertpapiere							10.118.600,00	0,52
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
USD								
US912796QP72	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2018)		30.000.000	0	30.000.000	99,5256	25.708.340,62	1,31
							25.708.340,62	1,31
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							25.708.340,62	1,31
Anleihen							35.826.940,62	1,83

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
Optionsscheine								
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Schweiz								
CWN5647P3137	Merrill Lynch International & Co./MSCI Saudi Arabia Index (USD) WTS v.16(2019)	USD	25.500	3.500	22.000	1.139,5600	21.586.292,41	1,10
							21.586.292,41	1,10
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Optionsscheine								
							21.586.292,41	1,10
Investmentfondsanteile²⁾								
Deutschland								
DE0008490988	DWS Inter Genuss	EUR	0	0	284.032	39,5400	11.230.625,28	0,57
DE000A0M80M2	UniFavorit: Aktien -I-	EUR	0	0	327.591	161,4200	52.879.739,22	2,70
							64.110.364,50	3,27
Finnland								
FI0008812011	Evlvi Nordic Corporate Bond	EUR	103.500	0	103.500	145,7600	15.086.160,00	0,77
							15.086.160,00	0,77
Frankreich								
IE00B906V41	FundLogic Alternatives Plc. - IPM Systematic Macro UCITS Fund	EUR	0	2.082	7.273	1.034,8984	7.526.816,06	0,38
IE00BWFRC140	Lyxor / Chenavari Credit Fund	EUR	0	0	33.517	102,5924	3.438.589,47	0,18
IE00B844SH66	Lyxor/WNT Fund	EUR	0	18.893	68.758	108,1243	7.434.410,62	0,38
FR0007078811	METROPOLE Funds SICAV - Metropole Selection	EUR	0	0	25.915	630,2000	16.331.633,00	0,83
FR0013275070	OFI Risk Arb Absolu FCP	EUR	0	0	55.412	100,8600	5.588.854,32	0,29
FR0010757831	Syquant Capital - Helium Opportunites	EUR	0	9.359	30.216	1.348,5790	40.748.663,06	2,08
							81.068.966,53	4,14
Großbritannien								
IE00BKZGL097	Barings Emerging Markets Local Debt Fund	EUR	106.944	0	106.944	91,6400	9.800.348,16	0,50
IE00BLD2FW69	Coupland Cardiff Funds Plc. - CC Japan Alpha Fund	JPY	650.000	0	650.000	2.162,2270	10.655.386,04	0,54
IE00B8G2MF47	Insight LIBOR Plus Fund	EUR	0	47.180.692	14.550.297	1,1267	16.393.819,63	0,84
IE0032904330	J O Hambro Capital Management Umbrella Fund Plc. - Euro A Shs Fund	EUR	0	0	13.744.537	3,7170	51.088.444,03	2,61
IE00BYQP5B29	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund	USD	156.435	0	156.435	127,8700	17.223.474,64	0,88
IE00BYW7BD64	Marshall Wace UCITS Funds PLC - MW Liquid Alpha Fund	EUR	0	30.390	94.903	106,2577	10.084.174,50	0,51
IE00BYW7B815	Marshall Wace UCITS Funds Plc. MW Liquid Alpha Fund - Klasse A Euro	EUR	0	0	222.169	110,6268	24.577.845,53	1,25
IE00BLP55791	Merian Global Investors Series PLC - Merian Global Equity Absolute Return Fund	EUR	0	1.649.961	7.742.616	1,6435	12.724.989,40	0,65
IE00BPT2B085	Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund	EUR	0	0	700.000	9,7700	6.839.000,00	0,35
IE00BDZRX300	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	EUR	0	0	3.100.000	10,4400	32.364.000,00	1,65
IE00BZ1J0335	Odey Investments PLC - Odey European Focus Absolute Return Fund	EUR	0	0	49.595	97,3467	4.827.909,59	0,25
							196.579.391,52	10,03
Irland								
IE00B2005F46	Aegon European ABS Fund	EUR	1.000.000	0	1.000.000	10,4977	10.497.700,00	0,54
IE00BYZTN220	BLACKWALL EUROPE L/S FUND	EUR	0	239.016	1.031.804	9,8800	10.194.223,52	0,52
IE00B762GJ90	BNY Mellon Global Funds PLC - Emerging Markets Debt Fund	EUR	0	26.500	26.744	160,9370	4.304.099,13	0,22
IE00BCZRQT02	Fort Global UCITS Funds PLC - Contrarian Fund	EUR	0	0	10.493	1.098,0300	11.521.628,79	0,59
IE00B6TLWG59	GAM Star Fund Plc. - Cat Bond Fund	EUR	905.000	0	1.211.000	13,2493	16.044.902,30	0,82
IE00B59P9M57	GAM Star Fund Plc. - Global Rates	EUR	0	178.553	1.216.342	10,8313	13.174.565,10	0,67
IE00BYPJR538	GAM Star Fund plc - MBS Total Return	USD	0	0	2.000.000	11,0900	19.097.640,78	0,97
IE00B50JD354	GAM Star Plc. - Credit Opportunities Fund	EUR	0	0	1.750.000	15,1787	26.562.725,00	1,35
IE00B5429P46	GLG Investments VI Plc. - European Equity Alternative	EUR	41.200	40.357	210.944	119,4900	25.205.698,56	1,29
IE00BYW8Z598	Hedge I.I.Fds-HI Quantwave	EUR	46.498	0	46.498	103,1400	4.795.803,72	0,24
IE00BLG30Y36	Hedge Invest International Funds - HI Numen Credit Fund	EUR	0	60.526	207.329	98,6400	20.450.932,56	1,04
IE00B3LVG697	MAN Funds VI PLC - Man GLG Alpha Select Alternative	EUR	94.709	17.103	77.606	131,7200	10.222.262,32	0,52
IE00BYVYQ87	MAN Funds VI PLC - Man GLG European Alpha Alternative	EUR	100.000	0	100.000	98,2400	9.824.000,00	0,50
IE00BDRKT177	MAN Funds VI PLC - Man Glg Innovation Equity Alternative	EUR	89.822	16.586	73.236	104,5600	7.657.556,16	0,39
IE00B6VHBN16	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Capital Securities Fund	EUR	0	850.000	2.422.461	13,1800	31.928.035,98	1,63
IE00BD3JM62	PIMCO GIS Mortgage Opportunities Fund	USD	0	0	1.961.592	10,5300	17.785.055,76	0,91

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
IE0003895277	PineBridge Asia ex Japan Small Cap Equity Fund	USD	0	0	24.640	643,6712	13.655.982,75	0,70
IE00BF0J8075	Trium Opportunistic Equity Fund	EUR	0	0	33.292	89,5700	2.981.964,44	0,15
							255.904.776,87	13,05
Luxemburg								
LU1021293185	AB Mortgage Income Portfolio S1 USD Inc	USD	0	0	500.000	16,7500	7.211.124,50	0,37
LU0476877054	Aberdeen Global - Japanese Smaller Companies Fund	EUR	0	0	1.249.874	26,6018	33.248.898,17	1,70
LU1040796796	AGENDA SICAV - Liquid Premium	EUR	0	0	1.069.142	10,0500	10.744.877,10	0,55
LU1664206528	Allianz Discovery Germany Strategy	EUR	0	2.359	10.055	995,3300	10.008.043,15	0,51
LU1570265261	Alpha UCITS SICAV - Fair Oaks Dynamic Credit Fund	EUR	0	0	15.000	1.020,7600	15.311.400,00	0,78
LU0272941112	Amundi Funds - Absolute Volatility Euro Equities	EUR	0	2.293	15.793	1.111,1900	17.549.023,67	0,89
LU1744899805	Amundi Funds II - European Equity Value J	EUR	16.087	0	16.087	973,2700	15.656.994,49	0,80
LU1103259088	AQR UCITS Funds - Style Premia UCITS Fund	EUR	0	14.462	71.599	105,8600	7.579.470,14	0,39
LU0493865678	Ashmore SICAV - Emerging Markets Local Currency Bond Fund	EUR	0	65.000	218.506	65,3700	14.283.737,22	0,73
LU0575255335	Assenagon Alpha Volatility	EUR	0	1.956	9.792	1.038,1400	10.165.466,88	0,52
LU1382784764	BlackRock Strategic Funds - Global Event Driven Fund	EUR	140.000	19.342	120.658	106,4200	12.840.424,36	0,65
LU1337225053	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	EUR	0	20.354	106.641	120,4200	12.841.709,22	0,65
LU1063708694	Boussard & Gavaudan SICAV - Absolute Return	EUR	0	2.341	11.871	1.088,8500	12.925.738,35	0,66
LU0784437740	BPI Global Investments Fund - BPI Alternative Iberian Equities Long short Fund	EUR	0	204.927	1.064.618	12,1200	12.903.170,16	0,66
LU0501220262	CGS FMS SICAV - Global Evolution Frontier Markets (Sub - Fund 1)	EUR	0	0	133.146	153,1100	20.385.984,06	1,04
LU0893376748	Cigogne UCITS - M&A Arbitrage	EUR	0	5.285	20.019	1.141,8100	22.857.894,39	1,17
LU1572743505	DB Platinum Midocean Absolute Return Credit	EUR	0	500	1.500	10.086,3000	15.129.450,00	0,77
LU1047850851	DNB Fund - TMT Absolute Return	EUR	0	34.942	134.603	115,4280	15.536.955,08	0,79
LU1155061614	Exane Funds 1 - Exane Archimedes Fund Cl. E	EUR	0	451	1.831	9.660,9000	17.689.107,90	0,90
LU0961411492	Falcon - Twelve-Falcon Insurance Linked Strategy Fund	EUR	0	0	46.000	107,8000	4.958.800,00	0,25
LU0650958159	Fidelity Active Strategy - Emerging Markets Fund	USD	0	0	387.680	154,1600	51.459.229,21	2,62
LU1135780176	Goldman Sachs - SICAV I - GS Global Strategic Macro Bond Ptf	EUR	0	49.697	255.435	98,9700	25.280.401,95	1,29
LU0490769915	Janus Henderson Fund - Janus Henderson United Kingdom Absolute Return Fund	EUR	0	652.291	2.469.930	7,1958	17.773.122,29	0,91
LU0248049412	JPMorgan Funds - Europe Strategic Value Fund	EUR	0	0	144.942	111,4100	16.147.988,22	0,82
LU0189453631	Julius Bär Multibond - ABS Fund	EUR	0	0	196.952	113,9900	22.450.558,48	1,14
LU1388736503	Jupiter Global Fund - Jupiter Global Absolute Return	EUR	0	0	960.000	9,4200	9.043.200,00	0,46
LU0522256634	Jupiter JGF - Global Convertibles	EUR	0	0	777.967	13,8300	10.759.283,61	0,55
LU1602251818	Laffitte Risk Arbitrage UCITS/Luxembourg	EUR	0	644	1.577	11.281,6900	17.791.225,13	0,91
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia	EUR	0	5.022	17.654	1.156,3800	20.414.732,52	1,04
LU0394778749	LO Funds - Convertible Bond Asia USD	USD	0	0	786.800	16,9717	11.497.618,01	0,59
LU0834815101	LRI OptoFlex	EUR	0	24.941	16.377	1.280,9000	20.977.299,30	1,07
LU0489687755	Mandarine Funds - Mandarine Unique Small & Mid Caps Europe	EUR	0	0	230	97.380,1400	22.397.432,20	1,14
LU0476438642	Melchior European Absolute Return Fund	EUR	0	0	11.180	107,7312	1.204.435,26	0,06
LU1358059555	Melchior Selected Trust - Velox Fund	EUR	0	35.677	137.032	111,4602	15.273.612,76	0,78
LU0562189042	Merrill Lynch Investment Solutions - AQR Global Relative Value UCITS Fund	EUR	0	7.659	70.591	105,0500	7.415.584,55	0,38
LU1468410581	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Cross-Asset Volatility Premium Fd	EUR	0	100.000	240.000	103,3600	24.806.400,00	1,26
LU0994402526	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Volatility Premium Fund	EUR	0	0	191.385	122,3800	23.421.696,30	1,19
LU0333226826	Merrill Lynch Investment Solutions - Marshall Wace Tops UCITS Fund	EUR	0	0	121.009	145,6500	17.624.917,16	0,90
LU1680845879	Merrill Lynch Investment Solutions - Ramius Merger Arbitrage UCITS Fund	EUR	0	0	50.000	102,6100	5.130.500,00	0,26
LU1067856788	Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark US Equity Fund A1	EUR	0	0	1.731	14.726,9500	25.492.350,45	1,30
LU1732224917	Pareto SICAV - Pareto Nordic Corporate Bond	EUR	0	0	254.894	101,7513	25.935.795,86	1,32
LU0194438841	Parvest - Japan Small Cap	EUR	0	0	330.249	176,7900	58.384.720,71	2,98
LU0823411292	Parvest Equity USA Small Cap	EUR	0	0	93.895	259,8760	24.401.058,15	1,24
LU1071462532	Pictet TR - Agora	EUR	0	59.047	160.760	127,7900	20.543.520,40	1,05
LU0635020901	Pictet TR - Kosmos	EUR	0	0	244.846	109,2600	26.751.873,96	1,36
LU0273643493	RWC Funds SICAV - RWC Global Convertibles Fund	EUR	0	0	6.781	1.603,0400	10.870.214,24	0,55
LU1429039461	Schroder Gaia Two Sigma Diversified	EUR	0	0	139.165	113,8500	15.843.935,25	0,81
LU1469429549	Threadneedle Lux - Pan European Absolute Alpha	EUR	0	0	310.000	10,5000	3.255.000,00	0,17
LU1669793827	UI - Aktia EM Frontier Bond+	EUR	79.500	0	129.775	97,2500	12.620.618,75	0,64
LU0090772608	UniEuropa Mid&Small Caps	EUR	0	0	649.930	54,8600	35.655.159,80	1,82
LU0006041197	UniFavorit: Renten	EUR	0	2.050.000	684.640	24,0600	16.472.438,40	0,84
LU1088284630	Uninstitutional CoCo Bonds	EUR	0	0	48.511	99,3500	4.819.567,85	0,25

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
LU1545615871	UniInstitutional EM Corporate Bonds Flexible	EUR	0	0	25.000	96,8400	2.421.000,00	0,12
LU1589413688	UniInstitutional EM High Yield Bonds	EUR	0	0	25.000	94,9600	2.374.000,00	0,12
LU0482734919	UniInstitutional EM Sovereign Bonds	EUR	0	0	112.078	82,2800	9.221.777,84	0,47
LU1131313493	UniInstitutional European Equities Concentrated	EUR	206.000	0	206.000	142,2500	29.303.500,00	1,49
LU0315299569	UniInstitutional Global Convertibles	EUR	0	0	45.000	114,5300	5.153.850,00	0,26
LU1756676109	UniInstitutional MultiPremia	EUR	0	0	100.000	91,8600	9.186.000,00	0,47
LU0175818722	UniInstitutional Short Term Credit	EUR	0	0	754.079	46,4900	35.057.132,71	1,79
LU1832180779	UniInstitutional Structured Credit	EUR	70.000	0	70.000	100,1400	7.009.800,00	0,36
LU1099836758	UniInstitutional Structured Credit High Yield	EUR	15.000	0	84.200	120,5900	10.153.678,00	0,52
LU0247467987	UniReserve: Euro-Corporates	EUR	0	35.000	98.418	42,4700	4.179.812,46	0,21
LU1602255561	Vontobel Fund - Twentyfour Monument European Asset Backed Securities	EUR	0	0	100.000	101,9100	10.191.000,00	0,52
							1.035.995.310,62	52,81
Vereinigte Staaten von Amerika								
IE0031574977	Brandes Investment Funds PLC - Brandes European Value Fund	EUR	0	0	435.991	38,2500	16.676.655,75	0,85
							16.676.655,75	0,85
							1.665.421.625,79	84,92
Investmentfondsanteile								
Zertifikate								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Australien								
XS1590565625	Macquarie Bank Ltd. (London Branch)/Maquarie Commodity Product 233T Index Zert. v.17(2020)	USD	0	0	349.895	102,1300	30.768.707,03	1,57
							30.768.707,03	1,57
							30.768.707,03	1,57
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Deutschland								
XS0461202136	Dte. Bank AG (London Branch)/DBLCI FLEX 40 USD TRAC Index Zert. v.14(2019)	USD	26.000	0	52.000	98,5600	4.412.881,01	0,23
							4.412.881,01	0,23
Europäische Gemeinschaft								
DE000DDF52H8	DZ Bank AG Frankfurt am Main/Euro Stoxx 50 Zert. v.18(2019)	EUR	580.000	0	580.000	34,5200	20.021.600,00	1,02
DE000DD2JTX0	DZ Bank AG/Euro Stoxx 50 Index Zert. v.17(2019)	EUR	315.000	0	630.000	35,4400	22.327.200,00	1,14
							42.348.800,00	2,16
Frankreich								
XS1673285638	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV/BNP Paribas Strategy 3YCL Index Zert. v.17(2020)	USD	102	82	135	127.644,1094	14.837.226,43	0,76
							14.837.226,43	0,76
Schweiz								
XS1605262119	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 109 Total Return Index Zert. v.17(2019)	USD	0	0	350	207.900,0000	62.652.832,79	3,19
							62.652.832,79	3,19
Vereinigte Staaten von Amerika								
XS1009877918	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 140 Total Return Index Zert. v.17(2018)	USD	11	0	24	212.280,0000	4.386.705,70	0,22
							4.386.705,70	0,22
							128.638.445,93	6,56
							159.407.152,96	8,13
							1.907.915.708,92	97,24
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Zertifikate								
Wertpapiervermögen								
Optionen								
Long-Positionen								
EUR								
Call on Bayer AG November 2018/76,00			20	0	20		6.400,00	0,00
Call on Continental AG Oktober 2018/155,00			20	0	20		3.040,00	0,00
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,145			50.000.000	0	50.000.000		293.150,00	0,01
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,17			66.000.000	0	66.000.000		83.886,00	0,00
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.625,00			20.000	0	20.000		1.400.000,00	0,07
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.700,00			16.000	0	16.000		352.000,00	0,02
Call on Stoxx 600 Banks Index November 2018/162,50			600	0	600		55.500,00	0,00

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
	Call on thyssenkrupp AG Oktober 2018/21,00	100	50	50		6.250,00	0,00
	Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,500	0	0	4.000		-50.000,00	0,00
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.300,00	1.500	0	1.500		852.000,00	0,04
	Put on EUR/USD Oktober 2018/1,2554	100.000.000	0	100.000.000		7.987.200,00	0,41
	Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Oktober 2018/130,50	1.700	800	900		85.500,00	0,00
	Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/2,875	36.800.000	0	36.800.000		366.380,80	0,02
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,250	3.000	0	3.000		-18.750,00	0,00
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/99,875	3.000	0	3.000		-18.750,00	0,00
	Put on 3MO Euribor Future März 2019/100,000	0	0	4.000		-275.000,00	-0,01
						11.128.806,80	0,56
GBP							
	Call on GBP/USD November 2018/1,35	30.000.000	0	30.000.000		124.764,15	0,01
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,75	4.500	0	4.500		48.185,78	0,00
						172.949,93	0,01
HKD							
	Call on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/12.200,00	2.400	0	2.400		146.109,85	0,01
						146.109,85	0,01
USD							
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/122,00	3.000	0	3.000		2.583,09	0,00
	Call on USD/MXN Dezember 2018/20,25	25.000.000	0	25.000.000		97.425,52	0,00
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/98,125	0	0	3.000		16.144,31	0,00
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,125	0	0	3.000		16.144,31	0,00
	Call on 3MO Euro-Dollar Future November 2018/97,50	6.000	0	6.000		32.288,62	0,00
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.900,00	125	0	125		898.269,33	0,05
	Put on USD/TRY November 2018/4,599	17.500.000	0	17.500.000		15,07	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,875	2.000	0	5.000		699.586,71	0,04
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,625	4.000	0	4.000		452.040,64	0,02
						2.214.497,60	0,11
	Long-Positionen					13.662.364,18	0,69
Short-Positionen							
EUR							
	Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,175	0	50.000.000	-50.000.000		-47.150,00	0,00
	Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,20	0	66.000.000	-66.000.000		-9.702,00	0,00
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.400,00	0	2.000	-2.000		-1.574.000,00	-0,08
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index Oktober 2018/3.500,00	0	2.900	-2.900		-133.400,00	-0,01
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Oktober 2018/160,50	0	690	-690		-41.400,00	0,00
	Call on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Senior Financial S30 5Yr Index CDS November 2018/0,70	0	75.000.000	-75.000.000		-18.900,00	0,00
	Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,375	0	0	-4.000		75.000,00	0,00
	Put on Bayer AG Oktober 2018/64,00	0	25	-25		-175,00	0,00
	Put on Continental AG Oktober 2018/145,00	0	25	-25		-4.375,00	0,00
	Put on Dte. Bank AG, London (Morgan Grenfell) AG/iTraxx Europe S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/0,800	0	53.600.000	-53.600.000		-39.610,40	0,00
	Put on EUR/USD Oktober 2018/1,2376	0	100.000.000	-100.000.000		-6.455.600,00	-0,33
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Oktober 2018/156,50	0	690	-690		34.500,00	0,00
	Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/3,250	0	36.800.000	-36.800.000		-179.620,80	-0,01
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,125	0	6.000	-6.000		37.500,00	0,00
	Put on 3MO Euribor Future März 2019/99,75	0	0	-4.000		125.000,00	0,01
						-8.231.933,20	-0,42
GBP							
	Call on GBP/USD November 2018/1,40	0	30.000.000	-30.000.000		-11.927,22	0,00
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,625	0	4.500	-4.500		-47.648,86	0,00
						-59.576,08	0,00
HKD							
	Call on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/11.000,00	0	400	-400		-122.641,62	-0,01
	Put on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/10.500,00	0	400	-400		71.238,23	0,00
						-51.403,39	-0,01

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
USD							
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/120,00	0	1.500	-1.500		-100.901,93	-0,01
	Call on USD/MXN Dezember 2018/21,25	0	25.000.000	-25.000.000		-30.545,03	0,00
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/97,875	0	0	-3.000		-48.432,93	0,00
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,00	0	0	-3.000		-16.144,31	0,00
	Call on 3MO Euro-Dollar Future November 2018/97,625	0	6.000	-6.000		-32.288,62	0,00
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/117,00	0	1.500	-1.500		-40.360,77	0,00
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/118,00	0	3.000	-3.000		-363.246,94	-0,02
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.700,00	0	250	-250		-932.064,75	-0,05
	Put on USD/TRY November 2018/4,30	0	17.500.000	-17.500.000		0,00	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,50	0	2.000	-5.000		-53.814,36	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,375	0	4.000	-4.000		-107.628,72	-0,01
						-1.725.428,36	-0,09
Short-Positionen						-10.068.341,03	-0,52
Optionen						3.594.023,15	0,17
Terminkontrakte							
Long-Positionen							
EUR							
	DAX Performance-Index Future Dezember 2018	3	0	3		825,00	0,00
	Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2022	2.301	0	2.301		208.749,99	0,01
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2018	1.830	600	1.230		-140.549,88	-0,01
	Stoxx 600 Banks Future Dezember 2018	190	0	190		500,00	0,00
	Stoxx 600 Financial Services Future Dezember 2018	32	0	32		-160,00	0,00
	Stoxx 600 Health Care Future Dezember 2018	21	0	21		10.352,60	0,00
	Stoxx 600 Oil&Gas Future Dezember 2018	30	0	30		36.000,00	0,00
	Stoxx 600 Retail Future Dezember 2018	126	0	126		32.480,03	0,00
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Dezember 2018	41	0	41		10.045,00	0,00
	VSTOXX Index Future Oktober 2018	1.290	0	1.290		-21.010,00	0,00
						137.232,74	0,00
GBP							
	LIF 3MO Sterling Future März 2020	2.800	0	2.800		-235.849,06	-0,01
						-235.849,06	-0,01
JPY							
	Japanese Yen Currency Future Dezember 2018	83	0	83		95.962,71	0,00
						95.962,71	0,00
USD							
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future Dezember 2018	94	0	94		132.655,42	0,01
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019	6.700	4.900	1.800		-190.632,00	-0,01
	MSCI World Index Future Dezember 2018	337	0	337		52.755,30	0,00
	US Dollar Currency Future Dezember 2018	1.932	0	1.932		-1.528.349,41	-0,08
						-1.533.570,69	-0,08
Long-Positionen						-1.536.224,30	-0,09
Short-Positionen							
CHF							
	ABB Ltd. Future Dezember 2018	0	220	-220		-3.775,92	0,00
	Kühne + Nagel International AG Future Dezember 2018	0	40	-40		-6.149,15	0,00
	LafargeHolcim Ltd. Future Dezember 2018	100	150	-50		-16.030,50	0,00
	Nestle S.A. Future Dezember 2018	50	130	-80		-7.466,15	0,00
	Panalpina Welttransport Holding AG Future Dezember 2018	0	50	-50		-10.255,20	0,00
						-43.676,92	0,00
EUR							
	Accor S.A. Future Dezember 2018	0	90	-90		-15.395,40	0,00
	CAC 40 Index Future Oktober 2018	0	20	-20		-21.420,00	0,00
	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Future Dezember 2018	0	100	-100		1.932,00	0,00
	Dte. Lufthansa AG Future Dezember 2018	0	255	-255		42.982,80	0,00
	Dte. Post AG Future Dezember 2018	0	120	-120		9.210,00	0,00
	DWS Group GmbH & Co. KGaA Future Dezember 2018	0	100	-100		-4.346,00	0,00

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2020	0	2.301	-2.301		-151.299,99	-0,01
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Dezember 2018	0	18	-18		-8.190,00	0,00
	EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2018	230	280	-50		-39.000,00	0,00
	EUX 5YR Euro-Bobl Future Dezember 2018	500	1.000	-500		-45.110,00	0,00
	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future Dezember 2018	0	60	-60		-4.981,80	0,00
	Gea Group AG Future Dezember 2018	0	50	-50		1.712,50	0,00
	HeidelbergCement AG Future Dezember 2018	0	40	-40		-6.647,20	0,00
	Hugo Boss AG Future Dezember 2018	10	100	-90		28.365,30	0,00
	Kering S.A. Future Dezember 2018	0	20	-20		-37.355,13	0,00
	Koninklijke Philips NV Future Dezember 2018	0	280	-280		-7.232,40	0,00
	MSCI Europe Index Future Dezember 2018	0	3.673	-3.673		-1.509.606,67	-0,08
	MSCI World Net EUR Future Dezember 2018	0	1.870	-1.870		-877.224,48	-0,04
	Österreichische Post AG Future Dezember 2018	50	100	-50		1.107,50	0,00
	Peugeot S.A. Future Dezember 2018	40	220	-180		7.938,00	0,00
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future Dezember 2018	0	30	-30		11.295,00	0,00
	SKF AB -B- Future Dezember 2018	0	300	-300		-15.045,00	0,00
	S&P-MIB Future Dezember 2018	8	30	-22		14.740,00	0,00
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Dezember 2018	0	6.389	-6.389		-1.792.111,31	-0,09
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future Dezember 2018	0	53	-53		530,00	0,00
	Stoxx 600 Basic Resources Future Dezember 2018	0	65	-65		-112.450,00	-0,01
	Stoxx 600 Chemicals Future Dezember 2018	0	30	-30		-19.800,00	0,00
	Stoxx 600 Construction&Materials Future Dezember 2018	0	40	-40		-8.000,00	0,00
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Dezember 2018	0	40	-40		-9.400,00	0,00
	Stoxx 600 Telecommunications Future Dezember 2018	0	151	-151		-9.430,00	0,00
	Stoxx 600 Utilities Future Dezember 2018	0	55	-55		-4.650,00	0,00
	thyssenkrupp AG Future Dezember 2018	0	150	-150		-33.811,50	0,00
						-4.612.693,78	-0,23
GBP							
	Burberry Group Plc. Future Dezember 2018	0	20	-20		19.822,55	0,00
	Cobham Plc. Future Dezember 2018	0	325	-325		7.334,40	0,00
	FTSE 100 Index Future Dezember 2018	5	11	-6		-14.083,56	0,00
	LIF 3MO Sterling Future März 2019	0	2.800	-2.800		-39.308,18	0,00
	Smiths Group Plc. Future Dezember 2018	5	15	-10		8.040,99	0,00
	Tesco Plc. Future Dezember 2018	0	75	-75		-2.756,83	0,00
	WPP Plc. Future Dezember 2018	13	38	-25		3.910,32	0,00
						-17.040,31	0,00
HKD							
	Hang Seng China Enterprises Index Future Oktober 2018	0	120	-120		27.070,45	0,00
						27.070,45	0,00
JPY							
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Dezember 2018	0	77	-77		-844.138,22	-0,04
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Dezember 2018	0	1.118	-1.118		-8.268.440,84	-0,42
						-9.112.579,06	-0,46
USD							
	CBOE Volatility Index (VIX) Future November 2018	0	373	-373		35.974,34	0,00
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Dezember 2018	1.700	2.950	-1.250		866.074,35	0,04
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2020	0	1.800	-1.800		636.214,91	0,03
	E-Mini S&P 500 Index Future Dezember 2018	80	110	-30		-10.009,47	0,00
	MSCI Asia Pacific ex Japan Future Dezember 2018	0	339	-339		-189.727,91	-0,01
	MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future Dezember 2018	0	1.314	-1.314		-1.694.272,55	-0,09
	Russell 2000 Future Dezember 2018	0	135	-135		47.158,60	0,00
	Tesla Inc. Future Dezember 2018	0	10	-10		15.379,28	0,00
						-293.208,45	-0,03
Short-Positionen						-14.052.128,07	-0,72
Terminkontrakte						-15.588.352,37	-0,81

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
Credit Default Swaps							
Gekauft							
EUR							
	Barclays Bank Plc./Vereinigte Staaten von Amerika CDS v.17(2021)	0	0	100.000.000		-314.426,00	-0,02
	Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	0	100.000.000		-2.236.232,00	-0,11
	J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 3Yr Index CDS v.17(2020)	0	0	160.000.000		-2.737.542,40	-0,14
						-5.288.200,40	-0,27
USD							
	J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.18(2023)	20.000.000	0	20.000.000		-524.920,27	-0,03
	J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.18(2023)	30.000.000	0	30.000.000		-787.380,40	-0,04
						-1.312.300,67	-0,07
Gekauft							
Verkauft							
EUR							
	Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 10Yr Index CDS v.17(2027)	0	0	-54.000.000		450.230,94	0,02
	J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	0	-100.000.000		2.086.945,00	0,11
						2.537.175,94	0,13
						2.537.175,94	0,13
						-4.063.325,13	-0,21
Credit Default Swaps							
Sonstige Finanzinstrumente							
AUD							
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	0	0	34.000.000		2.503.736,86	0,13
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	0	0	-34.000.000		-2.640.491,31	-0,13
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	0	0	-65.000.000		-5.129.239,59	-0,26
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	0	0	65.000.000		4.787.561,47	0,24
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	0	0	-82.000.000		-2.044.577,11	-0,10
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	0	0	82.000.000		2.193.203,64	0,11
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	0	0	150.000.000		4.029.759,16	0,21
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	0	0	-150.000.000		-3.728.712,30	-0,19
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM AUSTRALIAN EXPORTERS/STRATEGIE JPM AUSTRALIAN EXPORTERS 15.08.19	16.858.815	0	16.858.815		-26.706,43	0,00
						-55.465,61	0,01
CZK							
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.0575% 12.07.2024	1.050.000.000	0	1.050.000.000		4.733.865,28	0,24
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.0575% 12.07.2024	0	1.050.000.000	-1.050.000.000		-3.890.156,31	-0,20
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.4720% 20.09.2024	0	535.000.000	-535.000.000		-2.369.929,41	-0,12
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.4720% 20.09.2024	535.000.000	0	535.000.000		2.407.888,55	0,12
	SWAP 2.0150%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 12.07.2021	2.588.000.000	0	2.588.000.000		3.901.086,70	0,20
	SWAP 2.0150%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 12.07.2021	0	2.588.000.000	-2.588.000.000		-4.765.521,47	-0,24
	SWAP 2.4700%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 20.09.2021	1.300.000.000	0	1.300.000.000		2.390.413,83	0,12
	SWAP 2.4700%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 20.09.2021	0	1.300.000.000	-1.300.000.000		-2.406.603,31	-0,12
						1.043,86	0,00
EUR							
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5440% 04.09.2024	60.000.000	0	60.000.000		2.010.326,40	0,10
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5440% 04.09.2024	0	60.000.000	-60.000.000		-1.622.110,80	-0,08
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5510% 28.08.2024	60.000.000	0	60.000.000		1.998.390,00	0,10
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5510% 28.08.2024	0	60.000.000	-60.000.000		-1.643.173,20	-0,08
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0050% 12.04.2023	0	400.000.000	-400.000.000		-3.987.560,00	-0,20
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0050% 12.04.2023	400.000.000	0	400.000.000		3.550.008,00	0,18
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5190% 11.09.2028	0	52.500.000	-52.500.000		-3.794.287,88	-0,19
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5190% 11.09.2028	52.500.000	0	52.500.000		4.047.011,33	0,21
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5385% 11.09.2028	20.300.000	0	20.300.000		1.564.844,38	0,08
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5385% 11.09.2028	0	20.300.000	-20.300.000		-1.485.958,58	-0,08
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	0	0	3.000.000		3.326.453,22	0,17
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	0	0	-3.000.000		-3.385.870,23	-0,17
	SWAP 0.1000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.09.2021	148.000.000	0	148.000.000		296.939,80	0,02
	SWAP 0.1000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.09.2021	0	148.000.000	-148.000.000		-596.056,68	-0,03

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
	SWAP 0.1040%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 28.08.2021	0	150.000.000	-150.000.000		-589.821,00	-0,03
	SWAP 0.1040%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 28.08.2021	150.000.000	0	150.000.000		313.005,00	0,02
	SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 12.04.2021	0	400.000.000	-400.000.000		-980.760,00	-0,05
	SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 12.04.2021	400.000.000	0	400.000.000		1.464.768,00	0,07
	SWAP 1.5125%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 27.06.2020	122.500.000	0	122.500.000		126.813.462,65	6,47
	SWAP 1.5125%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 27.06.2020	0	122.500.000	-122.500.000		-127.306.394,08	-6,49
	SWAP 1.5325%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.06.2020	120.000.000	0	120.000.000		124.033.086,00	6,33
	SWAP 1.5325%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.06.2020	0	120.000.000	-120.000.000		-124.466.158,80	-6,35
	Total Return SWAP iBoxx EUR Liquid High Yield Index (IBOXXMJA)/EURIBOR (EUR) 3 Monate 20.12.18	50.000.000	0	50.000.000		91.488,00	0,00
	Total Return SWAP iBoxx Euro CORPORATES OVERALL Index (TOTAL RETURN)/EURIBOR (EUR) 3 Monate 20.12.18	50.000.000	0	50.000.000		31.242,50	0,00
	Total Return SWAP Strategie GS UI ARP Swap/Strategie GS UI ARP Swap 18.01.19	0	10.561.430	19.378.000		-38.000,06	0,00
	Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.08.19	21.298.468	0	21.298.468		-540.310,40	-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU 19.07.19	5.062.811	0	5.062.811		97.912,89	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE DB Tax Profiteure EU/STRATEGIE DB Tax Profiteure EU 14.12.18	122.440	0	20.498.000		262.021,43	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Car of the Future/STRATEGIE JPM Car of the Future 15.08.19	14.666.685	0	14.666.685		-645.172,81	-0,03
	Total Return SWAP Strategie JPM Europe Quality Index/Strategie JPM Europe Quality Index 15.08.19	20.106.060	0	20.106.060		157.805,83	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM European Equity L/S/STRATEGIE JPM European Equity L/S 15.08.19	100.000.000	0	100.000.000		-130.000,00	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Robotics/STRATEGIE JPM HCT Robotics 15.08.19	9.548.400	0	9.548.400		-647.379,99	-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.08.19	38.788.240	0	38.788.240		-428.240,01	-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FSI Europe/STRATEGIE zu MS FSI Europe 01.06.19	0	55.000.000	10.000.000		-132.250,00	-0,01
	Total Return SWAP Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND/Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND 18.03.19	19.987.200	0	19.987.200		-45.980,75	0,00
						-2.406.719,84	-0,10
GBP							
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19	37.396.368	24.792.414	12.603.954		254.267,93	0,01
						254.267,93	0,01
JPY							
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	0	0	-5.350.000.000		-1.111.583,11	-0,06
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	0	0	5.350.000.000		1.329.638,47	0,07
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	0	0	2.600.000.000		679.059,05	0,03
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	0	0	-2.600.000.000		-618.623,63	-0,03
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	0	0	5.400.000.000		1.441.955,02	0,07
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	0	0	-5.400.000.000		-1.537.220,87	-0,08
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	0	0	10.700.000.000		412.070,25	0,02
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	0	0	-10.700.000.000		-484.157,64	-0,02
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	0	0	-5.300.000.000		-265.156,31	-0,01
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	0	0	5.300.000.000		231.630,14	0,01
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	0	0	10.700.000.000		631.344,47	0,03
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	0	0	-10.700.000.000		-558.554,57	-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 15.08.19	1.981.600.000	0	1.981.600.000		258.744,58	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.08.19	2.582.547.500	0	2.582.547.500		-18.109,33	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 02.11.18	0	0	2.412.979.489		493.778,10	0,03
						884.814,62	0,04
USD							
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium III Index (USD) 27.11.18	50.037.956	0	50.037.956		-264.374,82	-0,01
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	3.900.000	0	3.900.000		-29.199,06	0,00
	Excess Return SWAP/J.P. Morgan Locator Strategy exAL 11.10.18	749.302	809.710	25.060.491		-426.123,94	-0,02
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.18	7.918.976	22.345.106	150.573.870		-3.363.350,15	-0,17
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	2.700.000	0	2.700.000		96.832,41	0,00
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	2.700.000	0	2.700.000		-7.047,78	0,00
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & LvstK Finl Index 11.10.18	11.761.456	24.607.872	152.153.584		4.362.529,11	0,22
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9270% 29.08.2028	0	137.000.000	-137.000.000		-29.508.299,54	-1,50
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9270% 29.08.2028	137.000.000	0	137.000.000		31.267.807,03	1,59
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9485% 04.09.2028	0	68.500.000	-68.500.000		-14.886.962,15	-0,76

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9485% 04.09.2028	68.500.000	0	68.500.000		15.663.600,22	0,80
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1700% 20.06.2020	0	146.000.000	-146.000.000		-124.734.030,20	-6,36
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1700% 20.06.2020	146.000.000	0	146.000.000		125.177.449,58	6,38
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.2025% 27.06.2020	150.000.000	0	150.000.000		128.512.684,69	6,55
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.2025% 27.06.2020	0	150.000.000	-150.000.000		-128.154.869,98	-6,54
	SWAP 2.8825%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2023	0	129.000.000	-129.000.000		-15.512.111,16	-0,79
	SWAP 2.8825%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2023	129.000.000	0	129.000.000		14.643.382,68	0,75
	SWAP 2.9040%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2023	0	64.300.000	-64.300.000		-7.762.718,54	-0,40
	SWAP 2.9040%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2023	64.300.000	0	64.300.000		7.380.487,32	0,38
	SWAP 2.9465%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2048	0	29.000.000	-29.000.000		-15.081.895,46	-0,77
	SWAP 2.9465%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2048	29.000.000	0	29.000.000		14.277.084,54	0,73
	SWAP 2.9700%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2048	0	14.500.000	-14.500.000		-7.544.671,11	-0,38
	SWAP 2.9700%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2048	14.500.000	0	14.500.000		7.198.169,43	0,37
	SWAP 3.0100%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028	70.900.000	0	70.900.000		7.289.877,08	0,37
	SWAP 3.0100%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028	0	70.900.000	-70.900.000		-7.649.300,52	-0,39
	SWAP 3.0555%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028	28.400.000	0	28.400.000		2.964.204,15	0,15
	SWAP 3.0555%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028	0	28.400.000	-28.400.000		-3.064.035,75	-0,16
	Total Return SWAP STRATEGIE BARC COMMODITY LIQUIDITY/STRATEGIE BARC COMMODITY LIQUIDITY 18.10.19	24.998.507	0	24.998.507		-37.682,65	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE Barclays FX Month End/STRATEGIE Barclays FX Month End 19.07.19	12.532.905	0	12.532.905		-134.191,11	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 18.10.19	91.052.630	0	91.052.630		-466.333,87	-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 18.10.19	44.010.042	0	44.010.042		134.019,18	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 18.10.19	35.685.329	0	35.685.329		383.123,82	0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE Dte. Bank Commodity Curve Spread Long Short USD ER Index/STRATEGIE Dte. Bank Commodity Curve	17.472.429	74.471	17.397.958		-164.120,69	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE Dte. Bank Commodity Momentum Alpha Long Short USD ER Index/STRATEGIE Dte. Bank Commodity Mom	4.192.051	994.836	3.197.215		-11.649,61	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.08.19	28.868.310	0	28.868.310		-49.590,90	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.08.19	36.677.524	0	36.677.524		325.884,25	0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.08.19	47.595.400	0	47.595.400		302.391,84	0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.08.19	35.214.514	0	35.214.514		200.314,01	0,01
	Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.08.19	35.225.520	0	35.225.520		-508.792,50	-0,03
	Total Return SWAP Strategie JPM ItalyHygiene/Strategie JPM ItalyHygiene 15.08.19	11.925.552	0	11.925.552		-136.528,37	-0,01
	Total Return SWAP Strategie JPM Northamerica Quality/Strategie JPM Northamerica Quality 15.08.19	23.299.161	0	23.299.161		-97.761,79	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 15.08.19	18.407.786	0	18.407.786		-2.746.636,54	-0,14
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM SPX Intraday Trend/STRATEGIE JPM SPX Intraday Trend 15.05.19	24.688.800	0	24.688.800		-1.148.958,16	-0,06
	Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.08.19	47.936.592	0	47.936.592		-260.196,14	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Sectorneutral/STRATEGIE JPM Value Sectorneutral 15.02.19	181.575	36.596.460	24.063.000		-757.623,78	-0,04
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE 2 STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE 2 STRATEGY 15.05.19	23.794.500	0	23.794.500		-125.327,39	-0,01
	Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 18.03.19	12.545.000	0	12.545.000		115.593,63	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index/STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index 18.12.18	2.400	339.200	10.940.000		-7.926,37	0,00
	Total Return SWAP Strategie zu MS Global Rates Curve Carry/Strategie zu MS Global Rates Curve Carry 20.09.19	50.596.650	0	50.596.650		-76.071,85	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex Italy Strategy /STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex	69.690.100	0	69.690.100		-70.345,95	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy/STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy 20.09.19	20.129.600	0	20.129.600		-139.142,44	-0,01
						-4.632.435,30	-0,22
						-5.954.494,34	-0,26
						45.255.081,72	2,31
						29.827.353,39	1,56
						1.960.985.995,34	100,00

Sonstige Finanzinstrumente

Bankguthaben - Kontokorrent

Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten

Fondsvermögen in EUR

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

2) Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Devisentermingeschäfte

Zum 30.09.2018 standen folgende offene Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
			EUR	
AUD/EUR	Währungskäufe	8.400.000,00	5.216.075,94	0,27
USD/EUR	Währungskäufe	13.900.000,00	11.922.069,12	0,61
SEK/EUR	Währungskäufe	73.100.000,00	7.078.710,91	0,36
NZD/EUR	Währungskäufe	9.500.000,00	5.405.433,08	0,28
NOK/EUR	Währungskäufe	522.594.000,00	55.203.209,92	2,82
JPY/EUR	Währungskäufe	1.834.000.000,00	13.900.393,50	0,71
GBP/EUR	Währungskäufe	7.100.000,00	7.960.435,51	0,41
CZK/EUR	Währungskäufe	564.563.765,00	21.877.472,90	1,12
CHF/EUR	Währungskäufe	7.000.000,00	6.174.004,62	0,31
CAD/EUR	Währungskäufe	9.700.000,00	6.443.941,04	0,33
EUR/JPY	Währungsverkäufe	1.064.000.000,00	8.064.350,42	0,41
EUR/NOK	Währungsverkäufe	102.200.000,00	10.786.442,48	0,55
EUR/NZD	Währungsverkäufe	6.100.000,00	3.470.857,03	0,18
EUR/SEK	Währungsverkäufe	690.466.757,20	66.858.823,55	3,41
EUR/USD	Währungsverkäufe	9.600.000,00	8.233.947,02	0,42
EUR/AUD	Währungsverkäufe	10.400.000,00	6.457.998,80	0,33
EUR/CHF	Währungsverkäufe	17.300.000,00	15.258.611,41	0,78
EUR/GBP	Währungsverkäufe	9.000.000,00	10.090.692,90	0,51

Bilaterale Devisentermingeschäfte

Zum 30.09.2018 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
				EUR	
AUD/CAD	Bilaterale Währungsgeschäfte	48.284.576,85	45.317.775,00	30.075.639,47	1,53
AUD/JPY	Bilaterale Währungsgeschäfte	34.000.000,00	2.738.470.500,00	21.149.642,16	1,08
JPY/AUD	Bilaterale Währungsgeschäfte	2.809.383.110,00	34.000.000,00	21.336.367,88	1,09
JPY/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	4.393.742.200,00	40.000.000,00	33.375.728,20	1,70
SEK/NOK	Bilaterale Währungsgeschäfte	210.695.316,00	195.000.000,00	20.422.045,86	1,04
USD/JPY	Bilaterale Währungsgeschäfte	40.000.000,00	4.402.132.800,00	34.374.511,64	1,75

Bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich

Zum 30.09.2018 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
				EUR	
USD/KRW	Bilaterale Währungsgeschäfte	47.000.000,00	52.590.900.000,00	40.443.833,09	2,06

UniAbsoluterErtrag

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 30. September 2018 in Euro umgerechnet.

Australischer Dollar	AUD	1	1,6048
Britisches Pfund	GBP	1	0,8904
Dänische Krone	DKK	1	7,4571
Hongkong Dollar	HKD	1	9,0874
Japanischer Yen	JPY	1	131,9002
Kanadischer Dollar	CAD	1	1,5010
Mexikanischer Peso	MXN	1	21,7155
Neuseeländischer Dollar	NZD	1	1,7512
Norwegische Krone	NOK	1	9,4569
Polnischer Zloty	PLN	1	4,2809
Schwedische Krone	SEK	1	10,3283
Schweizer Franken	CHF	1	1,1344
Singapur Dollar	SGD	1	1,5865
Südafrikanischer Rand	ZAR	1	16,4311
Südkoreanischer Won	KRW	1	1.288,1087
Tschechische Krone	CZK	1	25,7760
Ungarischer Forint	HUF	1	323,3700
US Amerikanischer Dollar	USD	1	1,1614

Zu- und Abgänge vom 1. April 2018 bis 30. September 2018

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Schuldscheindarlehen und Derivaten, einschließlich Änderungen ohne Geldbewegungen, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Aktien, Anrechte und Genussscheine			
Börsengehandelte Wertpapiere			
Belgien			
BE0974268972	bpost S.A.	112.000	132.000
Dänemark			
DK0010244508	A P Moller-Maersk AS	400	400
Deutschland			
DE000A1EWWW0	adidas AG	12.000	12.000
DE000BASF111	BASF SE	48.500	48.500
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	10.400	10.400
DE0005439004	Continental AG	3.000	5.200
DE0006062144	Covestro AG	17.200	17.200
DE0007100000	Daimler AG	27.500	27.500
DE0005140008	Dte. Bank AG	18.000	18.000
DE0005557508	Dte. Telekom AG	47.000	94.000
DE0005773303	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	26.000	26.000
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	5.000	5.000
DE0006047004	HeidelbergCement AG	10.500	10.500
DE000A2AADD2	innogy SE	16.000	16.000
DE0005408884	Leoni AG	6.000	6.000
DE0006483001	Linde AG	4.500	4.500
DE000A2E4L75	Linde AG - Zum Umtausch eingereichte Aktien-	3.000	3.000
DE0005937007	MAN SE	4.000	4.000
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	2.400	2.400
DE000LED4000	OSRAM Licht AG	12.500	12.500
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	12.300	21.300
DE0006969603	PUMA SE	21	21
DE0007236101	Siemens AG	19.335	26.335
DE0007472060	Wirecard AG	2.700	7.700
DE0005545503	1&1 Drillisch AG	12.000	12.000
Finnland			
FI0009005318	Nokian Renkaat OYJ	36.500	46.880

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Frankreich			
FR000120404	Accor S.A.	14.000	14.000
FR000125338	Capgemini S.A.	4.500	4.500
FR000121261	Cie Generale des Etablissements Michelin	1.500	7.000
FR000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	39.500	39.500
FR000121667	Essilor International S.A.	4.700	8.300
FR0010307819	Legrand S.A.	5.000	5.000
FR000130577	Publicis Groupe S.A.	0	4.500
FR000121972	Schneider Electric SE	34.500	34.500
Großbritannien			
GB0006731235	Associated British Foods Plc.	15.000	15.000
GB0002875804	British American Tobacco Plc.	27.000	27.000
GB0031743007	Burberry Group Plc.	70.500	70.500
GB00B7KR2P84	EASYJET Plc.	18.000	18.000
GB0033195214	Kingfisher Plc.	300.000	300.000
GB0032089863	Next Group Plc.	6.500	6.500
GB00BDVZY77	Royal Mail Plc.	50.000	50.000
GB00B10RZP78	Unilever Plc.	16.000	16.000
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc.	1.298.905	1.298.905
Irland			
IE0001827041	CRH Plc.	84.630	84.630
Italien			
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	38.000	38.000
IT0001347308	Buzzi Unicem S.p.A.	83.667	94.390
IT0004965148	Moncler S.p.A.	48.500	63.000
IT0005162406	Technogym S.p.A.	47.000	47.000
Jersey			
JE00B8KF9B49	WPP Plc.	78.500	78.500
Niederlande			
NL0012969182	Adyen N.V.	30	30
NL0000235190	Airbus SE	8.500	11.000
NL0010273215	ASML Holding NV	2.000	2.000
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles NV	13.000	13.000
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize NV	64.000	64.000
NL0011821392	Signify N.V.	10.000	10.000
NL0000009355	Unilever NV	24.000	24.000
Portugal			
PTCTT0AM0001	CTT-Correios de Portugal S.A.	223.000	323.000
Schweden			
SE0006886750	Atlas Copco AB	24.000	24.000
SE0011166636	Atlas Copco AB -Redemption shares-	24.000	24.000
SE0011166933	Epiroc AB	22.000	22.000
SE0000106270	Hennes & Mauritz AB	22.000	22.000
SE0000108227	SKF AB -B-	25.000	25.000
SE0000115446	Volvo AB	32.000	32.000
Schweiz			
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	15.400	15.400
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	2.300	2.300
CH0030170408	Geberit AG	4.219	4.719
CH0010645932	Givaudan S.A.	570	570
CH0012214059	LafargeHolcim Ltd.	17.000	17.000
CH0002168083	Panalpina Weltransport Holding AG	5.000	9.000
CH0012032113	Roche Holding AG	1.588	1.588
CH0000587979	Sika AG	30	30
CH0012255151	Swatch Group	750	1.250
CH0012255144	Swatch Group AG	0	3.500

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Spanien			
ES0148396007	Industria de Diseño Textil S.A.	4.000	24.000
ES0177542018	International Consolidated Airlines Group S.A.	53.000	53.000
ES0178430E18	Telefonica S.A.	45.000	95.000
Vereinigte Staaten von Amerika			
US88160R1014	Tesla Inc.	2.700	2.700
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
Dänemark			
DK0060228559	TDC AS	0	35.000
Großbritannien			
GB00B1WY2338	Smiths Group Plc.	15.000	15.000
Anleihen			
Börsengehandelte Wertpapiere			
EUR			
XS1807305328	5,625 % Ägypten Reg.S. v.18(2030)	400.000	400.000
XS1748389688	2,500 % Chengdu Xingcheng Investment Group Co. Ltd. v.18(2021)	0	100.000
XS1824424706	0,000 % Petróleos Mexicanos v.18(2029)	200.000	200.000
XS1810963147	1,375 % State Grid Overseas Investment (2016) Reg.S. v.18(2025)	300.000	300.000
USD			
XS1808738212	4,875 % Abu Dhabi National Energy Co. Reg.S. v.18(2030)	300.000	300.000
XS1772360803	6,797 % Akbank T.A.S. Reg.S. Fix-to-Float v.18(2028)	0	200.000
US01609WAV46	4,200 % Alibaba Group Holding Ltd. v.17(2047)	0	200.000
US03512TAB70	6,500 % AngloGold Ashanti Holdings Plc. v.10(2040)	0	500.000
XS1719264324	9,750 % Anton Oilfield Services Group/Hong Kong v.17(2020)	0	400.000
XS1627599654	8,750 % China Evergrande Group Reg.S. v.17(2025)	0	400.000
US302154CU14	3,075 % Export-Import Bank of Korea FRN v.18(2023)	300.000	300.000
XS1756563919	7,250 % Fantasia Holdings Group Co. Ltd. v.18(2019)	0	400.000
XS1810806395	6,250 % Firstrand Ltd. FRN v.18(2023)	300.000	300.000
USY39694AA51	5,875 % Indika Energy Capital III Pte. Ltd. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USN4717BAD84	6,500 % Jababeka International BV Reg.S. v.16(2023)	0	200.000
XS1807299331	6,375 % KazMunaiGaz Finance Sub B.V. Reg.S. v.18(2048)	200.000	200.000
USY59505AA82	6,750 % Medco Platinum Road Pte. Ltd. Reg.S. v.18(2025)	0	200.000
US67778NAA63	7,500 % Oil & Gas Holding Company B.S.C. Reg.S. v.17(2027)	0	200.000
XS1750114396	6,750 % Oman Reg.S. v.18(2048)	0	200.000
XS1805474951	5,625 % Oztel Holdings SPC Ltd. Reg.S. v.18(2023)	200.000	200.000
XS1805359939	6,950 % Powerlong Real Estate Holdings Ltd. v.18(2021)	500.000	500.000
XS1791939736	5,000 % Saudi Arabien Reg.S. v.18(2049)	500.000	500.000
XS1759179002	5,200 % Shimao Property Holdings Ltd. v.18(2025)	0	300.000
XS1809230474	7,350 % Sunac China Holdings Ltd. v.18(2021)	300.000	300.000
XS1748392559	3,750 % Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. v.18(2023)	0	200.000
US88032XAG97	3,595 % Tencent Holdings Ltd. Reg.S. v.18(2028)	300.000	300.000
XS1698689301	5,250 % Trillion Chance Ltd. v.17(2018)	0	200.000
XS1803215869	5,800 % Turkcell Iletisim Hizmetleri AS Reg.S. v.18(2028)	300.000	300.000
XS1750996206	5,500 % Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS EMTN v.18(2023)	0	200.000
XS1823770828	3,880 % Vanke Real Estate (Hong Kong Branch) Co. Ltd. FRN EMTN v.18(2023)	200.000	200.000
USG9328DAP53	6,125 % Vedanta Resources Plc. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
XS0889401724	5,950 % VimpelCom Holdings BV Reg.S. v.13(2023)	200.000	200.000
XS1728036952	4,750 % Yankuang Group (Cayman) Ltd. Reg.S. v.17(2020)	200.000	200.000
XS1734639799	4,750 % Yankuang Group (Cayman) Ltd. v.17(2020)	0	200.000
XS1788516679	6,100 % Yapi Ve Kredi Bankasi AS Reg.S. v.18(2023)	0	300.000
XS1619839779	7,375 % Zenith Bank Plc. Reg.S. v.17(2022)	0	200.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
EUR			
XS1242327168	2,750 % BRF S.A. Reg.S. v.15(2022)	0	200.000
XS1679505070	1,625 % Rail Transit International Development Co. Ltd. Greenbond v.18(2022)	0	200.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
USD			
USL0178WAG70	7,500 % Altice Financing S.A. Reg.S. v.16(2026)	0	400.000
USP20058AC08	6,875 % Capex S.A. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USC3535CAJ74	6,875 % First Quantum Minerals Ltd. Reg.S. v.18(2026)	0	200.000
USG38327AA30	6,500 % GeoPark Ltd. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
US44891CAV54	3,261 % Hyundai Capital America FRN Reg.S. v.18(2021)	100.000	100.000
USP5R6DPAA84	6,125 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Fix-to-Float Perp.	0	200.000
USP5R6DPAB67	6,500 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Perp.	0	300.000
XS1533923238	8,750 % Kernel Holding S.A. Reg.S. v.17(2022)	0	400.000
USG5825AAB82	6,875 % MARB BondCo Plc. Reg.S. v.18(2025)	0	200.000
XS1713469911	6,950 % MHP Lux S.A. Reg.S. v.18(2026)	200.000	600.000
USL6366MAC75	8,250 % MHP S.A. Reg.S. v.13(2020)	0	200.000
XS1577965004	7,750 % MHP SE Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USL6388GAB60	5,125 % Millicom International Cellular S.A. Reg.S. v.17(2028)	0	300.000
USN6945AAK36	5,999 % Petrobras Global Finance BV Reg.S. v.17(2028)	0	200.000
USL79090AA13	7,375 % Rumo Luxembourg Sàrl Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
XS1759468967	4,850 % Rusal Capital D.A.C. Reg.S. v.18(2023)	0	200.000
USA8372TAC20	7,000 % Suzano Austria GmbH Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
USG91237AA87	7,000 % Tullow Oil Plc. Reg.S. v.18(2025)	0	400.000
USP94461AE36	7,375 % Unifin Financiera, S.A.B. de C.V., SOFOM, E.N.R. Reg.S. v.18(2026)	200.000	400.000
USG9844KAC39	6,250 % Yingde Gases Investment Ltd. Reg.S. v.18(2023)	0	200.000
USP989MJBNO3	7,000 % YPF S.A. Reg.S. v.17(2047)	200.000	400.000
Nicht notierte Wertpapiere			
EGP			
EGT9980B9116	0,000 % Ägypten v.17(2018)	0	235.000.000
USD			
XS1788498167	6,375 % Yuzhou Properties Co. Ltd. v.18(2021)	0	400.000
Credit Linked Notes			
Börsengehandelte Wertpapiere			
USD			
XS0805570354	4,950 % Gaz Capital S.A./Gazprom OAO CLN/LPN v.12(2022)	300.000	300.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
USD			
XS1772800204	5,075 % DME Airport DAC Ltd. LPN v.18(2023)	0	200.000
Investmentfondsanteile ¹⁾			
Deutschland			
DE000A1C81J5	Uninstitutional Euro Reserve Plus	0	222.319
Großbritannien			
IE00B7FN4C24	Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	0	1.275.000
Irland			
IE00B85RQ587	Muzinich Funds - Long Short Credit Yield	0	177.417
IE00BYQDQ804	Old Mutual Absolute Return Government Bond Fund	0	1.956.600
IE00B80G9288	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Income Fund	0	2.506.417
Luxemburg			
LU0313648254	Amundi Funds II-European Equity Value	0	8.242
LU0188167505	AXA IM FIIS - US Short Duration High Yield	0	70.000
LU0406668342	JPMorgan Funds - Systematic Alpha	0	112.627
LU0772928023	Nordea 1 SICAV - Emerging Market Bond Fund	103.640	103.640
LU1125543352	Serviced Platform SICAV - MSK Equity UCITS Fund	0	101.293
LU0765416804	SKY Harbor Global Funds - US Short Duration High Yield Fund	0	103.242
LU1577341644	Wellington Global Thematic Market Neutral Fund	0	510.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Optionen			
EUR			
	Call on EUR/JPY Mai 2018/140,00	40.000.000	0
	Call on Euro Bund 10 Year Future Juni 2018/160,50	2.800	2.800
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.475,00	2.000	2.000
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.450,00	0	1.000
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.475,00	3.000	3.000
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.600,00	6.000	6.000
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2018/163,50	740	740
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/163,00	600	600
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018/162,50	740	740
	Call on thyssenkrupp AG September 2018/21,00	110	110
	Call on thyssenkrupp AG September 2018/22,00	150	150
	Put on Dte. Bank AG August 2018/9,00	250	250
	Put on Dte. Bank AG August 2018/9,50	400	400
	Put on Dte. Börse AG Juni 2018/100,00	10	10
	Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/100,00	0	2.000
	Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/99,75	2.000	0
	Put on EUR/JPY Mai 2018/120,00	40.000.000	0
	Put on EUR/JPY Mai 2018/128,00	0	40.000.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index August 2018/3.000,00	100	100
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.000,00	1.500	1.500
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juli 2018/3.000,00	10	10
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.000,00	800	0
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.100,00	1.000	0
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.125,00	25	25
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2018/161,50	740	740
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/157,00	600	600
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/157,50	1.200	1.200
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018/158,50	740	740
	Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future August 2018/131,00	2.000	2.000
	Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Juli 2018/131,50	1.200	1.200
	Put on Gea Group AG Juli 2018/30,00	150	150
	Put on Goldman Sachs International., London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS Juni 2018/0,675	75.000.000	75.000.000
	Put on Unilever NV August 2018/47,00	150	150
	Put on Unilever NV August 2018/49,00	100	100
GBP			
	Call on Royal Mail Plc. Juni 2018/5,80	110	110
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,375	0	7.000
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,50	14.000	0
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,625	0	7.000
	Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,375	4.000	4.000
	Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,50	8.000	8.000
	Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,75	4.000	4.000
	Put on Royal Mail Plc. Juni 2018/6,10	20	20
JPY			
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/22.500,00	130	130
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/24.000,00	130	130
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/23.500,00	0	300
	Put on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/20.000,00	130	130
	Put on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/21.750,00	300	0
SEK			
	Call on Hennes & Mauritz AB Juli 2018/150,00	50	50
	Put on Hennes & Mauritz AB Juni 2018/120,00	250	250
USD			
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/120,50	1.340	1.340
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/121,50	2.500	2.500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Juli 2018/121,00	2.500	2.500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018/121,50	1.500	1.500
	Call on 3MO Euro-Dollar Future Oktober 2018/97,50	6.000	6.000
	Call on 3MO Euro-Dollar Future Oktober 2018/97,625	6.000	6.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Call on 5YR Treasury 6% Future April 2018/114,25	1.850	0
	Call on 5YR Treasury 6% Future August 2018/114,25	2.000	2.000
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/118,00	2.500	2.500
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/119,00	1.340	1.340
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Juli 2018/118,50	2.500	2.500
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018/119,50	1.500	1.500
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,75	3.000	0
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/97,00	0	3.000
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,00	3.000	0
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,25	0	3.000

Terminkontrakte

CHF

ABB Ltd. Future Juni 2018	300	300
ABB Ltd. Future September 2018	400	400
Flughafen Zuerich Future September 2018	40	40
Geberit AG Future Juni 2018	10	0
Kühne + Nagel International AG Future Juni 2018	50	50
Kühne + Nagel International AG Future September 2018	40	40
LafargeHolcim Ltd. Future Juni 2018	260	260
LafargeHolcim Ltd. Future September 2018	240	240
Nestlé S.A. Future Juni 2018	150	50
Nestlé S.A. Future September 2018	155	155
Panalpina Welttransport Holding AG Future Juni 2018	30	20
Panalpina Welttransport Holding AG Future September 2018	60	60
Swatch Group Future September 2018	120	120
Swiss Market Index Future Juni 2018	300	300
Temenos Group AG Future Juni 2018	10	10

EUR

Accor S.A. Future Juni 2018	125	75
Accor S.A. Future September 2018	120	120
Accor S.A. Future September 2018	50	50
adidas AG Future September 2018	15	15
Airbus SE Future Juni 2018	25	0
Anheuser-Busch InBev S.A./NV Future September 2018	75	75
Bayerische Motoren Werke AG Future Juni 2018	80	80
Bayerische Motoren Werke AG Future September 2018	65	65
CAC 40 Index Future September 2018	12	12
CAC 40 Index Future September 2018	10	10
Carrefour S.A. Future Juni 2018	250	50
Carrefour S.A. Future September 2018	250	250
Cie de Saint-Gobain Future Juni 2018	150	100
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Future September 2018	125	125
Continental AG Future Juni 2018	0	10
DAX Performance-Index Future Dezember 2018	6	6
DAX Performance-Index Future Juni 2018	87	217
DAX Performance-Index Future September 2018	120	120
DAX Performance-Index Future September 2018	12	12
Dte. Lufthansa AG Future Juni 2018	175	175
Dte. Lufthansa AG Future Mai 2018	175	50
Dte. Lufthansa AG Future September 2018	255	255
Dte. Post AG Future Juni 2018	210	210
Dte. Post AG Future September 2018	220	220
Dte. Telekom AG Future Juni 2018	0	150
DWS Group GmbH & Co. KGaA Future September 2018	100	100
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2018	3.170	3.170
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2018	1.915	1.915
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2018	5.540	5.540
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2018	1.922	1.922
EURO STOXX Automobiles&Parts Future Juni 2018	27	7
EURO STOXX Automobiles&Parts Future September 2018	1.137	1.137
EURO STOXX Automobiles&Parts Future September 2018	20	20
EURO STOXX Chemicals Future Juni 2018	0	190
EURO STOXX Chemicals Future September 2018	190	190

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Juni 2018	30	0
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future September 2018	41	41
	EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018	410	410
	EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Dezember 2018	100	100
	EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Juni 2018	150	0
	EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future September 2018	100	100
	EUX 5YR Euro-Bobl Future Juni 2018	1.200	1.200
	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future Juni 2018	90	10
	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future September 2018	60	60
	Gea Group AG Future September 2018	100	100
	HeidelbergCement AG Future September 2018	125	125
	Henkel AG & Co. KGaA Future Juni 2018	170	20
	Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future Juni 2018	0	80
	Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future September 2018	70	70
	Hugo Boss AG Future Juni 2018	135	80
	Hugo Boss AG Future September 2018	100	100
	Infineon Technologies AG Future Juni 2018	0	100
	International Consolidated Airlines Future Juni 2018	750	750
	International Consolidated Airlines Group S.A. Future September 2018	750	750
	iSTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (EUR) Future Juni 2018	3.384	0
	iSTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (EUR) Future September 2018	3.384	3.384
	iSTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018	0	7.000
	iSTX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future September 2018	7.000	7.000
	Kering S.A. Future Juni 2018	10	10
	Kering S.A. Future Juni 2018	10	10
	Kering S.A. Future September 2018	20	20
	Kone Corporation (New) Future Dezember 2018	50	50
	Kone Corporation (New) Future September 2018	115	115
	Koninklijke Philips NV Future Juni 2018	275	200
	Koninklijke Philips NV Future September 2018	280	280
	LIF 3MO Euribor Future Dezember 2019	1.500	1.500
	LIF 3MO Euribor Future September 2021	300	300
	Merck KGaA Future Juni 2018	110	55
	Merck KGaA Future September 2018	40	40
	MSCI Europe Index Future September 2018	3.789	3.789
	MSCI Europe Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018	2.439	0
	MSCI World Net EUR Future September 2018	1.870	1.870
	MSCI World Net EUR Index Future Juni 2018	1.870	0
	MTU Aero Engines AG Future Juni 2018	30	10
	Österreichische Post AG Future September 2018	135	135
	Peugeot S.A. Future September 2018	320	320
	ProSiebenSat.1 Media SE Future September 2018	120	120
	Publicis Groupe S.A. Future Juni 2018	40	40
	Publicis Groupe S.A. Future September 2018	20	20
	Safran SA Future Juni 2018	50	50
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future Juni 2018	20	20
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future September 2018	30	30
	Siemens Healthineers Future September 2018	100	100
	SKF AB -B- Future Juni 2018	360	360
	SKF AB -B- Future September 2018	760	760
	S&P-MIB Future September 2018	529	529
	S&P-MIB Index Future Juni 2018	497	497
	S&P-MIB Index Future Juni 2018	3	3
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Juni 2018	7.649	0
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future September 2018	7.649	7.649
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future Juni 2018	15	0
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future September 2018	53	53
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Banks Future September 2018	290	290
	Stoxx 600 Basic Resources Future September 2018	65	65
	Stoxx 600 Chemicals Future Juni 2018	30	30
	Stoxx 600 Chemicals Future September 2018	40	40
	Stoxx 600 Construction&Materials Future Juni 2018	46	0
	Stoxx 600 Construction&Materials Future September 2018	101	101
	Stoxx 600 Financial Services Future September 2018	32	32

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	STOXX 600 Food & Beverages Future Juni 2018	30	10
	STOXX 600 Food & Beverages Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Health Care Future September 2018	22	22
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Juni 2018	18	18
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future September 2018	40	40
	Stoxx 600 Oil&Gas Future September 2018	47	47
	Stoxx 600 Personal&Household Future September 2018	15	15
	Stoxx 600 Retail Future September 2018	134	134
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Juni 2018	55	0
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future September 2018	80	80
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future September 2018	45	45
	Stoxx 600 Telecommunications Future Juni 2018	196	150
	Stoxx 600 Telecommunications Future September 2018	351	351
	Stoxx 600 Telecommunications Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Travel&Leisure Future September 2018	66	66
	Stoxx 600 Utilities Future Juni 2018	80	100
	Stoxx 600 Utilities Future September 2018	55	55
	thyssenkrupp AG Future September 2018	250	250
	Valéo S.A. Future Juni 2018	60	30
	VSTOXX Index Future August 2018	1.170	1.170
	VSTOXX Index Future September 2018	1.250	1.250
	Wartsila Corporation Future September 2018	70	70
GBP			
	Associated British Foods Plc. Future Juni 2018	10	10
	Associated British Foods Plc. Future September 2018	11	11
	Burberry Group Plc. Future Juni 2018	40	40
	Burberry Group Plc. Future September 2018	30	30
	Cobham Plc. Future September 2018	325	325
	FTSE 100 Index Future Juni 2018	136	123
	FTSE 100 Index Future September 2018	151	151
	Kingfisher Plc. Future Juni 2018	75	75
	Kingfisher Plc. Future September 2018	100	100
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2018	4.000	0
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2019	0	4.000
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2020	450	450
	Next Group Plc. Future Juni 2018	10	10
	Rolls Royce Holdings Plc. Future September 2018	60	60
	Smiths Group Plc. Future September 2018	25	25
	Tesco Plc. Future Juni 2018	200	200
	Tesco Plc. Future September 2018	200	200
	WPP Plc. Future Juni 2018	45	45
	WPP Plc. Future September 2018	60	60
HKD			
	Hang Seng China Enterprises Index Future September 2018	120	120
JPY			
	Japanese Yen Currency Future September 2018	83	83
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future September 2018	77	77
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Juni 2018	1.427	150
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future September 2018	1.537	1.537
USD			
	CBOE Volatility Index (VIX) Future September 2018	370	370
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Dezember 2018	1.150	1.150
	CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018	1.457	1.457
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Dezember 2018	3.100	3.100
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Juni 2018	1.300	250
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future September 2018	3.100	3.100
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2018	1.850	450
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future September 2018	2.950	2.950
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Oktober 2018	367	367
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future September 2018	180	180
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2018	1.200	4.000
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2019	7.800	5.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019	1.000	1.000
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2018	1.962	1.705
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2018	1.939	1.939
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2018	518	518
	IXM Financial Select Sector Index Future September 2018	150	150
	MINI MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future Juni 2018	1.375	200
	MSCI Asia Pacific ex Japan Future September 2018	339	339
	MSCI Asia Pacific ex Japan Index Future Juni 2018	89	0
	MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future September 2018	2.353	2.353
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future Juni 2018	117	117
	MSCI USA EQUAL WEIGHTED USD Net Total Return RT Index Future September 2018	110	110
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Future September 2018	1.290	1.290
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future Juni 2018	1.296	72
	MSCI USA Momentum USD NTR Future September 2018	142	142
	MSCI USA Momentum USD NTR Index Future Juni 2018	142	142
	MSCI USA Quality Net USD Index Future September 2018	178	178
	MSCI USA Value Weight Capacity Index (Net Return) (USD) Future Juni 2018	0	3.436
	MSCI USA Value Weight Capacity Index (Net Return) (USD) Future September 2018	3.436	3.436
	MSCI World Index Future September 2018	444	444
	NYSE FANG+ Future September 2018	5	5
	NYSE FANG+ Index Future Juni 2018	5	3
	Russell 2000 Future September 2018	442	442
	Russell 2000 Index Future Juni 2018	0	442
	Tesla Inc. Future Juni 2018	10	10
	Tesla Inc. Future September 2018	20	20
	US Dollar Currency Future Juni 2018	290	3.186
	US Dollar Currency Future September 2018	2.607	2.607

Credit Default Swaps

EUR

Barclays Bank Plc./iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	75.000.000
Goldman Sachs International., London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Goldman Sachs International., London/iTraxx Europe S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	40.000.000	40.000.000

USD

Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Barclays Bank Plc./Spanien v.14(2044) CDS v.18(2023)	25.000.000	25.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Großbritannien CDS v.18(2022)	50.000.000	50.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Großbritannien CDS v.18(2022)	50.000.000	50.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Korea CDS v.18(2023)	50.000.000	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Großbritannien CDS v.17(2022)	0	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Spainien CDS v.18(2022)	50.000.000	0

Sonstige Finanzinstrumente

CZK

SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.6170% 24.04.2023	1.020.000.000	1.020.000.000
SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.6170% 24.04.2023	1.020.000.000	1.020.000.000

EUR

SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	90.000.000	0
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	0	90.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5300% 20.08.2024	121.000.000	121.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5300% 20.08.2024	121.000.000	121.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	16.750.000	0
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	0	16.750.000
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	130.000.000	0
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	0	130.000.000
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	65.000.000	0
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	0	65.000.000
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	65.000.000	0
SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	0	65.000.000
SWAP 0.0865%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.08.2021	295.000.000	295.000.000
SWAP 0.0865%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.08.2021	295.000.000	295.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
SWAP 0.4088%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 24.04.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.4088%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 24.04.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028		88.000.000	0
SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028		0	88.000.000
SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027		130.000.000	0
SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027		0	130.000.000
SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		65.000.000	0
SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		0	65.000.000
SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		65.000.000	0
SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		0	65.000.000
SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027		63.000.000	0
SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027		0	63.000.000
Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.02.19		1.232.320	41.141.920
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe/STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe 07.12.18		0	19.568.000
Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Capex/STRATEGIE JPM HCT Capex 15.02.19		15.100.500	15.100.500
Total Return SWAP Strategie JPM Italy/Strategie JPM Italy 15.08.19		22.335.918	22.335.918
Total Return SWAP STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER/STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER 15.05.19		20.735.560	20.735.560
Total Return SWAP STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER/STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER 15.05.19		19.979.980	19.979.980
Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.08.19		9.816.000	9.816.000
GBP			
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19		0	20.489.300
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19		28.695.087	28.695.087
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19		19.248.822	19.248.822
HUF			
SWAP BUBOR (HUF) 6 Monate/2.2300% 18.04.2024		31.900.000.000	31.900.000.000
SWAP BUBOR (HUF) 6 Monate/2.2300% 18.04.2024		31.900.000.000	31.900.000.000
SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023		10.000.000.000	0
SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023		0	10.000.000.000
SWAP 1.3000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 18.04.2022		31.300.000.000	31.300.000.000
SWAP 1.3000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 18.04.2022		31.300.000.000	31.300.000.000
JPY			
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18		0	2.115.200.000
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18		0	2.115.200.000
Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.08.19		1.291.273.750	1.291.273.750
Total Return SWAP STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY/STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY 15.02.19		0	1.266.340.800
PLN			
SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020		220.000.000	0
SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020		0	220.000.000
SEK			
SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027		626.000.000	0
SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027		0	626.000.000
USD			
Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18		0	25.000.000
Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 18.04.19		25.000.000	25.000.000
Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18		0	25.000.000
Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 18.04.19		25.000.000	25.000.000
Excess Return SWAP/DB Commodity Deferred 6 Index 11.10.18		0	27.000.000
Excess Return SWAP/DB Commodity Nearby 6 Index 11.10.18		0	27.000.000
Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 08.02.19		87.543	15.072.164
Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 13.02.19		82.468	14.198.368
Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18		71.137	12.247.488
Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18		70.507	12.139.103
Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18		69.814	12.019.812
Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.18		4.200.000	4.200.000
Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.18		0	7.000.000
Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.18		4.200.000	4.200.000
Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.18		0	7.000.000
Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18		3.500.000	3.500.000
Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 31.10.18		0	3.500.000
Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18		3.500.000	3.500.000
Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 31.10.18		0	3.500.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	367.300.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	0	367.300.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	633.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	0	633.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	31.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	0	31.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038	24.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038	0	24.000.000
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027	90.000.000	0
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027	0	90.000.000
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027	90.000.000	0
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027	0	90.000.000
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027	180.000.000	0
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027	0	180.000.000
	SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022	90.000.000	0
	SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022	0	90.000.000
	SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022	90.000.000	0
	SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022	0	90.000.000
	SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019	360.300.000	0
	SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019	0	360.300.000
	SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022	180.000.000	0
	SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022	0	180.000.000
	SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027	55.000.000	0
	SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027	0	55.000.000
	SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020	616.000.000	0
	SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020	0	616.000.000
	SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028	42.000.000	0
	SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028	0	42.000.000
	Total Return SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/S&P 500 Index TR 21.01.19	459.147	12.959.147
	Total Return SWAP S&P Regional Banks Select Industry Index/LIBOR (USD) 3 Monate 21.01.19	470.307	12.970.307
	Total Return SWAP STRATEGIE MS UI CUBE RATES/STRATEGIE MS UI CUBE RATES 20.03.19	0	87.017.400
	Total Return SWAP STRATEGIE Barclays FX Month End/STRATEGIE Barclays FX Month End 23.04.19	0	9.546.188
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 19.04.19	0	25.107.376
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 19.07.19	50.747.168	50.747.168
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 19.04.19	0	13.602.272
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 19.07.19	27.635.520	27.635.520
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 19.07.19	17.842.665	17.842.665
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 19.07.19	13.409.279	13.409.279
	Total Return SWAP STRATEGIE Barclays Weekly Var US/STRATEGIE Barclays Weekly Var US 18.04.19	13.555.297	13.555.297
	Total Return SWAP STRATEGIE DB Healthcare IT/STRATEGIE DB Healthcare IT 15.03.19	12.130.919	12.130.919
	Total Return SWAP STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY/STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY 04.12.18	0	23.892.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.02.19	30.540.300	30.540.300
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.05.19	40.170.040	40.170.040
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.02.19	0	25.060.025
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.02.19	0	25.318.325
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 02.08.18	660.550	11.906.950
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.08.19	23.119.206	23.119.206
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 31.07.18	728.200	11.974.600
	Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.08.19	25.618.560	25.618.560
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 15.02.19	0	12.440.662
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM PROFITEURE LNG LONG/LIBOR (USD) 6 Monate 15.02.19	0	12.725.063
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM PROFITEURE LNG LONG/LIBOR (USD) 6 Monate 15.08.19	18.476.549	18.476.549
	Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.08.19	23.899.348	23.899.348
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM US Regional Banks/STRATEGIE JPM US Regional Banks 15.05.19	12.685.200	12.685.200
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Tax/STRATEGIE JPM Value Tax 15.02.19	0	51.715.500
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY 15.02.19	0	25.704.000
	Total Return SWAP Strategie MS Global Equity Volatility/Strategie MS Global Equity Volatility 17.12.18	37.500	15.291.000
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FX Carry DM/STRATEGIE zu MS FX Carry DM 22.03.19	5.725	218.975

- 1) Angaben zu Ausgabebeschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Erläuterungen zum Bericht per Ende September 2018

Die Buchführung des Fonds erfolgt in Euro.

Der Halbjahresabschluss des Fonds wurde auf der Grundlage der im Domizilland gültigen Gliederungs- und Bewertungsgrundsätze erstellt.

Der Kurswert der Wertpapiere und sonstigen börsennotierten Derivate entspricht dem jeweiligen Börsen- oder Marktwert per Ende September 2018. An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden zu den an diesem Markt verzeichneten Marktpreisen bewertet. Investitionen in Zielfonds werden zu deren zuletzt veröffentlichten Kursen bewertet.

Soweit der Fonds zum Stichtag OTC-Derivate im Bestand hat, erfolgt die Bewertung auf Tagesbasis auf der Grundlage indikativer Broker-Quotierungen oder von finanzmathematischen Bewertungsmodellen.

Soweit der Fonds zum Stichtag schwebende Devisentermingeschäfte verzeichnet, werden diese auf der Grundlage der für die Restlaufzeit gültigen Terminkurse bewertet.

Wertpapiere, deren Kurse nicht marktgerecht sind, sowie alle Vermögenswerte für die keine repräsentativen Marktwerte erhältlich sind, werden zu einem Verkehrswert bewertet, den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und anerkannten Bewertungsregeln hergeleitet hat.

Das Bankguthaben wurde mit dem Nennwert angesetzt.

Die auf andere als auf die Fondswährung lautenden Vermögensgegenstände und Verbindlichkeiten wurden zu den letzten verfügbaren Devisenmittelkursen in Euro umgerechnet. Geschäftsvorfälle in Fremdwährungen werden zum Zeitpunkt der buchhalterischen Erfassung in die Fondswährung umgerechnet. Realisierte und unrealisierte Währungsgewinne und -verluste werden erfolgswirksam erfasst.

Die Zinsabgrenzung enthält die Stückzinsen zum Ende der Berichtsperiode.

Sofern der Fonds die Position Zinsen auf Anleihen enthält, beinhaltet diese, soweit zutreffend, auch anteilige Erträge aufgrund von Emissionsrenditen.

Der Fonds weist unterschiedliche Anteilsklassen aus, welche in ihrem Verhältnis zum Nettoinventarwert und nach Abzug zuzurechnender Aufwendungen an der Entwicklung des Fonds partizipieren.

Der Ausgabe- bzw. Rücknahmepreis der Fondsanteile wird vom Nettoinventarwert pro Anteil zu den jeweiligen gültigen Handelstagen und, soweit zutreffend, zuzüglich eines im Verkaufsprospekt definierten Ausgabeaufschlags und/oder Dispositionsausgleichs bestimmt. Der Ausgabeaufschlag wird zu Gunsten der Verwaltungsgesellschaft und der Vertriebsstelle erhoben und kann nach der Größenordnung des Kaufauftrages gestaffelt werden. Der Dispositionsausgleich wird dem Fonds gutgeschrieben.

Die Vergütung der Verwaltungsgesellschaft sowie die Pauschalgebühr werden auf Basis des kalendertäglichen Nettofondsvermögens erfasst und monatlich ausbezahlt. Die Pauschalgebühr deckt die Vergütung der Verwahrstelle, bankübliche Depot- und Lagerstellengebühren für die Verwahrung von Vermögensgegenständen, Honorare der Abschlussprüfer, Kosten für die Beauftragung von Stimmrechtsvertretungen und Kosten für Hauptverwaltungstätigkeiten, wie zum Beispiel die Fondsbuchhaltung sowie das Berichts- und Meldewesen, ab. Die Berechnung erfolgt auf der Grundlage vertraglicher Vereinbarungen.

Einzelne Anteilsklassen des Fonds unterliegen einer erfolgsabhängigen Vergütung, die auf der Grundlage der im Prospekt definierten Modalitäten von der Verwaltungsgesellschaft erhoben wird.

Sofern die Aufwands- und Ertragsrechnung sonstige Aufwendungen enthält, bestehen diese aus den im Verkaufsprospekt genannten Kosten wie beispielsweise staatliche Gebühren, Kosten für die Verwaltung von Sicherheiten oder Kosten für Prospektänderungen.

In den ordentlichen Nettoerträgen sind ein Ertragsausgleich und ein Aufwandsausgleich verrechnet. Diese beinhalten während der Berichtsperiode angefallene Nettoerträge, die der Anteilserwerber im Ausgabepreis mitbezahlt und der Anteilverkäufer im Rücknahmepreis vergütet erhält.

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer, der „Taxe d'abonnement“ von gegenwärtig 0,05 % per annum, zahlbar pro Quartal auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Netto-Fondsvermögen. Soweit das Fondsvermögen in anderen Luxemburger Investmentfonds angelegt ist, die ihrerseits bereits der Taxe d'abonnement unterliegen, entfällt diese Steuer für den Teil des Fondsvermögens, welcher in solche Luxemburger Investmentfonds angelegt ist.

Die Einnahmen aus der Anlage des Fondsvermögens werden in Luxemburg nicht besteuert, sie können jedoch etwaigen Quellen- oder Abzugsteuern in Ländern unterliegen, in welchen das Fondsvermögen angelegt ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Quittungen über solche Steuern für einzelne oder alle Anteilinhaber einholen.

Im Zusammenhang mit dem Abschluss von börsennotierten und/oder OTC-Derivaten hat der Fonds Sicherheiten in Form von Bankguthaben oder Wertpapieren zu liefern oder zu erhalten.

Die Positionen „Sonstige Bankguthaben/Bankverbindlichkeiten“ enthalten die vom Fonds gestellten/erhaltenen Sicherheiten in Form von Bankguthaben für börsennotierte Derivate und/oder gestellte Sicherheiten für OTC-Derivate. Gestellte Sicherheiten in Form von Wertpapieren werden in der Vermögensaufstellung gekennzeichnet. Erhaltene Sicherheiten in Form von Wertpapieren sowie Sicherheiten für OTC-Derivate in Form von Bankguthaben werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens und der Vermögensaufstellung nicht erfasst.

Die Wertentwicklung der Fondsanteile ist auf Basis der jeweils an den Stichtagen veröffentlichten Anteilwerte gemäß der BVI-Formel ermittelt worden. Sie kann im Einzelfall von der Entwicklung der Anteilwerte, wie sie im Fondsbericht ermittelt wurden, geringfügig abweichen.

Es können der Verwaltungsgesellschaft in ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft des Fonds im Zusammenhang mit Handelsgeschäften geldwerte Vorteile („soft commissions“, z. B. Broker-Research, Finanzanalysen, Markt- und Kursinformationssysteme) entstehen, die im Interesse der Anteilhaber bei den Anlageentscheidungen verwendet werden, wobei derartige Handelsgeschäfte nicht mit natürlichen Personen geschlossen werden, die betreffenden Dienstleister nicht gegen die Interessen des Fonds handeln dürfen und ihre Dienstleistungen im direkten Zusammenhang mit den Aktivitäten des Fonds erbringen.

Hinweis auf das Gesetz vom 17. Dezember 2010

Der Fonds wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen („Gesetz vom 17. Dezember 2010“) aufgelegt und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („Richtlinie 2009/65/EG“).

Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft

Sonstige Angaben

Wertpapiergeschäfte werden grundsätzlich nur mit Kontrahenten getätigt, die durch das Fondsmanagement in eine Liste genehmigter Parteien aufgenommen wurden, deren Zusammensetzung fortlaufend überprüft wird. Dabei stehen Kriterien wie die Ausführungsqualität, die Höhe der Transaktionskosten, die Researchqualität und die Zuverlässigkeit bei der Abwicklung von Wertpapierhandelsgeschäften im Vordergrund. Darüber hinaus werden die jährlichen Geschäftsberichte der Kontrahenten eingesehen.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte für den UniAbsoluterErtrag

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps ¹⁾
Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-6.113.176,13
in % des Fondsvermögen	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-0,31 %
Zehn größte Gegenparteien ²⁾			
1. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.234.544,33
1. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
2. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Goldman Sachs International., London
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-6.757,56
2. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
3. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Barclays Bank PLC
3. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-23.151,74
3. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
4. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutsche Bank AG, London
4. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-207.322,75
4. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
5. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	J.P. Morgan Securities PLC, London
5. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-7.110.488,41
5. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, Central Counterparty)			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	zweiseitig
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	662.839,65
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	577.029,78
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-7.366.172,04
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	13.126,48
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Arten	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Bankguthaben
Qualitäten ³⁾	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	2.030.000,00
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-5.334.070,94
in % der Bruttoerträge	nicht zutreffend	nicht zutreffend	133,69 %
Kostenanteil des Fonds	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.344.211,68
davon Kosten an Verwaltungsgesellschaft / Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
in % der Bruttoerträge	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
davon Kosten an Dritte / Ertragsanteil Dritter			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.344.211,68
in % der Bruttoerträge	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-33,69 %

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

nicht zutreffend

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps**Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds**

nicht zutreffend

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ⁴⁾

1. Name	Barclays Bank PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.100.000,00
2. Name	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	930.000,00

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swapskeine wiederangelegten Sicherheiten;
gemäß Verkaufsprospekt ist bei Bankguthaben eine Wiederanlage zu 100% möglich**Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps**

Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer	1
1. Name	DZ PRIVATBANK S.A.
1. Verwahrter Betrag absolut	2.030.000,00

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten / Depots	nicht zutreffend
Sammelkonten / Depots	nicht zutreffend
andere Konten / Depots	nicht zutreffend
Verwahrt bestimmt Empfänger	100 %

- 1) Die Sicherheiten für Total Return Swaps befinden sich in einem Sicherheitenpool, so dass auch andere Derivate darunter besichert sind.
- 2) Es werden nur die tatsächlichen Gegenparteien des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Gegenparteien kann weniger als zehn betragen.
- 3) Es werden nur Vermögensgegenstände als Sicherheit genommen, die für den Fonds nach Maßgabe des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 erworben werden dürfen und die Bestimmungen der entsprechenden CSSF-Rundschreiben erfüllen. Neben ggf. Bankguthaben handelt es sich um hochliquide Vermögensgegenstände, die an einem liquiden Markt mit transparenter Preisfeststellung gehandelt werden. Die gestellten Sicherheiten werden von Emittenten mit einer hohen Kreditqualität ausgegeben. Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds.
- 4) Es werden nur die tatsächlichen Sicherheitenaussteller des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Sicherheitenaussteller kann weniger als zehn betragen.

Verwaltungsgesellschaft und zugleich Hauptverwaltungsgesellschaft

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg
R.C.S.L. B 28679

Eigenkapital per 31.12.2017:
Euro 164,837 Millionen
nach Gewinnverwendung

Leitungsorgan der Union Investment Luxembourg S.A.:

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

Hans Joachim REINKE
Vorsitzender des Vorstandes der
Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Stv. Verwaltungsratsvorsitzender

Giovanni GAY
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Weitere Mitglieder des Verwaltungsrates

Dr. Frank ENGELS
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Nikolaus SILLEM
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Institutional GmbH
Frankfurt am Main

Maria LÖWENBRÜCK
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Dr. Joachim VON CORNBERG
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Karl-Heinz MOLL (bis zum 30.06.2018)
Mitglied des Verwaltungsrates

Karl-Heinz MOLL (ab dem 01.07.2018)
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Bernd SCHLICHTER
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Klaus Peter STRÄBER (bis zum 30.06.2018)
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Geschäftsführer der Union Investment Luxembourg S.A.

Maria LÖWENBRÜCK
Dr. Joachim VON CORNBERG

Gesellschafter der Union Investment Luxembourg S.A.

Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Auslagerung des Portfoliomanagements an folgende, der Union Investment Gruppe angehörende, Gesellschaften:

Union Investment Privatfonds GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Union Investment Institutional GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé)

Ernst & Young S.A.
35E avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

die zugleich Abschlussprüfer der
Union Investment Luxembourg S.A. ist.

Verwahrstelle und zugleich Hauptzahlstelle

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstelle im Großherzogtum Luxemburg

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstellen sowie Informationsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

DZ BANK AG
Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank
Platz der Republik
60265 Frankfurt am Main
Sitz: Frankfurt am Main

BBBank eG
Herrenstraße 2-10
76133 Karlsruhe
Sitz: Karlsruhe

Deutsche Apotheker- und Ärztebank eG
Richard-Oskar-Mattern-Str. 6
40547 Düsseldorf
Sitz: Düsseldorf

Weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

Die den vorgenannten Banken sowie den genossenschaftlichen Zentralbanken angeschlossenen Kreditinstitute sind weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland.

Zahl- und Vertriebsstelle in Österreich

VOLKSBANK WIEN AG
Kolingasse 14-16
A-1090 Wien

Weitere von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Fonds

BBBank Konzept Dividendenwerte Union
Commodities-Invest
FairWorldFonds
LIGA Portfolio Concept
LIGA-Pax-Cattolico-Union
LIGA-Pax-Corporates-Union
LIGA-Pax-Laurent-Union (2022)
PE-Invest SICAV
PrivatFonds: Konsequent
PrivatFonds: Konsequent pro
Quoniam Funds Selection SICAV
SpardaRentenPlus
UniAsia
UniAsiaPacific
UniAusschüttung
UniDividendenAss
UniDynamicFonds: Europa
UniDynamicFonds: Global
UniEM Fernost
UniEM Global
UniEM Osteuropa
UniEuroAnleihen
UniEuroAspirant
UniEuroKapital
UniEuroKapital Corporates
UniEuroKapital -net-
UniEuropa
UniEuropa Mid&Small Caps
UniEuropaRenta
UniEuroRenta Corporates
UniEuroRenta Corporates Deutschland 2019
UniEuroRenta Corporates 2018
UniEuroRenta EM 2021
UniEuroRenta EmergingMarkets
UniEuroRenta Real Zins
UniEuroRenta Unternehmensanleihen EM 2021
UniEuroRenta Unternehmensanleihen 2020
UniEuroRenta 5J
UniEuroSTOXX 50
UniExtra: EuroStoxx 50
UniFavorit: Aktien Europa
UniFavorit: Renten
UniGarant: Aktien Welt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2020) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2021)
UniGarant: Commodities (2019)
UniGarant: Deutschland (2019)
UniGarant: Deutschland (2019) II
UniGarant: Emerging Markets (2020)
UniGarant: Emerging Markets (2020) II
UniGarant: Nordamerika (2021)
UniGarant: Rohstoffe (2020)
UniGarantExtra: Deutschland (2019)
UniGarantExtra: Deutschland (2019) II

UniGarantTop: Europa
UniGarantTop: Europa II
UniGarantTop: Europa III
UniGarantTop: Europa IV
UniGarantTop: Europa V
UniGarant95: Aktien Welt (2020)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant95: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant95: Nordamerika (2019)
UniGlobal Dividende
UniGlobal II
UniIndustrie 4.0
UniInstitutional Asian Bond and Currency Fund
UniInstitutional Asset Balance Plus
UniInstitutional Basic Emerging Markets
UniInstitutional Basic Global Corporates HY
UniInstitutional Basic Global Corporates IG
UniInstitutional CoCo Bonds
UniInstitutional Convertibles Protect
UniInstitutional Corporate Hybrid Bonds
UniInstitutional EM Bonds 2018
UniInstitutional EM Corporate Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds Flexible
UniInstitutional EM Corporate Bonds Low Duration Sustainable
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2020
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2022
UniInstitutional EM High Yield Bonds
UniInstitutional EM Sovereign Bonds
UniInstitutional Euro Corporate Bonds 2019
UniInstitutional Euro Covered Bonds 2019
UniInstitutional Euro Subordinated Bonds
UniInstitutional European Bonds: Diversified
UniInstitutional European Bonds: Governments Peripherie
UniInstitutional European Corporate Bonds +
UniInstitutional European Equities Concentrated
UniInstitutional Financial Bonds 2022
UniInstitutional German Corporate Bonds +
UniInstitutional Global Convertibles
UniInstitutional Global Convertibles Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds Short Duration
UniInstitutional Global Corporate Bonds Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds 2022
UniInstitutional Global Covered Bonds
UniInstitutional Global Credit
UniInstitutional Global High Dividend Equities Protect
UniInstitutional Global High Yield Bonds
UniInstitutional IMMUNO Nachhaltigkeit
UniInstitutional Local EM Bonds
UniInstitutional Multi Credit
UniInstitutional MultiPremia
UniInstitutional SDG Equities
UniInstitutional Short Term Credit
UniInstitutional Structured Credit
UniInstitutional Structured Credit High Yield
UniKonzept: Dividenden

UniKonzept: Portfolio
UniMarktführer
UnionProtect: Europa (CHF)
UniOptima
UniOptimus -net-
UniOpti4
UniPacific Aktien
UniPremium Evolution 100
UniPremium Evolution 25
UniProfiAnlage (2019)
UniProfiAnlage (2019/II)
UniProfiAnlage (2020)
UniProfiAnlage (2020/II)
UniProfiAnlage (2021)
UniProfiAnlage (2023)
UniProfiAnlage (2023/II)
UniProfiAnlage (2024)
UniProfiAnlage (2025)
UniProfiAnlage (2027)
UniProInvest: Struktur
UniProtect: Europa II
UniRak Emerging Markets
UniRak Nachhaltig
UniRak Nachhaltig Konservativ
UniRak Nordamerika
UniRent Europa
UniRent Global
UniRent Kurz URA
UniRent Mündel
UniRent Mündel Flex
UniRenta Corporates
UniRentEuro Mix
UniRentEuro Staatsanleihen Flex
UniReserve
UniReserve: Euro-Corporates
UniSector
UniStruktur
UniValueFonds: Europa
UniValueFonds: Global
UniVorsorge 1
UniVorsorge 2
UniVorsorge 3
UniVorsorge 4
UniVorsorge 5
UniVorsorge 6
UniVorsorge 7
UniWirtschaftsAspirant
VBMH Vermögen

Die Union Investment Luxembourg S.A. verwaltet ebenfalls Fonds nach dem Gesetz vom 13. Februar 2007 über spezialisierte Investmentfonds.

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxemburg
service@union-investment.com
privatkunden.union-investment.de